



RBC BlueBay
Asset Management

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Halbjahresbericht einschließlich des ungeprüften
Abschlusses für den Berichtszeitraum
zum 31. Dezember 2023

R.C.S. Nr. B 88 020

Erstellt von:
Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.

Inhaltsverzeichnis

Geschäftsführung und Verwaltung	4
Zusammenfassung der Anlageziele der Teilfonds	6
Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte	
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund	17
BlueBay Funds – BlueBay High Yield ESG Bond Fund	26
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund	33
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund	39
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Select Bond Fund	42
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund	50
BlueBay Funds – BlueBay Global Convertible Bond Fund	59
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund	63
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund	67
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund	72
BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund	78
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund	86
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund	93
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund	99
BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund	107
BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund	114
BlueBay Funds – BlueBay Financial Capital Bond Fund	126
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund	129
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund	137
BlueBay Funds – BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund	149
BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund	151
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Structured Credit Fund	159
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund	164
BlueBay Funds – BlueBay High Grade Structured Credit Short Duration Fund	173
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade ESG Bond Fund	176
BlueBay Funds – BlueBay Impact – Aligned Bond Fund	181
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Government Bond Fund	186
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Financials Plus Bond Fund	190

Kopien des Halbjahresberichts einschließlich des ungeprüften Abschlusses für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 sind am Sitz der BlueBay Funds Management Company S.A. (die „Verwaltungsgesellschaft“), 4, Boulevard Royal, L-2449 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg, erhältlich. Bekanntmachungen an die Aktionäre werden in einer Luxemburger Tageszeitung sowie, falls erforderlich, im *Mémorial C, Recueil des Sociétés et Associations* veröffentlicht. Die Satzung der Société d'investissement à Capital Variable („SICAV“) wurde bei der Hauptregisterstelle des Bezirksgerichts Luxemburg („Greffier en chef du Tribunal d'Arrondissement de et à Luxembourg“) hinterlegt, wo sie eingesehen werden kann und auf Anfrage kostenlos Kopien ausgehändigt werden. Der Nettoinventarwert je Aktie der Teilfonds der SICAV wird in der *Financial Times* veröffentlicht. Die Ausgabe- und Rücknahmepreise sind am eingetragenen Sitz der SICAV oder bei RBC Global Asset Management (UK) Limited, 100, Bishopsgate, London, EC2N 4AA, Vereinigtes Königreich, erhältlich.

Auf der Grundlage dieses Berichts darf keine Zeichnung entgegengenommen werden. Die Zeichnungen erfolgen nur auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospektes und des letzten veröffentlichten Jahresberichts einschließlich des geprüften Abschlusses oder, falls danach ein Halbjahresbericht veröffentlicht wurde, auf der Grundlage dieses Halbjahresberichts.

Es ist zu beachten, dass die vergangene Performance keinen Anhaltspunkt für die zukünftige Performance bietet und dass sie eventuell nicht wieder erreicht wird. Der Wert von Anlagen und der mit ihnen erzielte Ertrag können sich sowohl verringern als auch erhöhen und es ist daher möglich, dass Anleger nicht den gleichen Betrag zurück erhalten, den sie investiert haben. Deshalb können Anleger nicht sicher sein, mit ihren Anlagen einen Gewinn zu erzielen, und es besteht die Möglichkeit, dass sie Geld verlieren.

Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Nettovermögensaufstellung	193
Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens	203
Statistische Angaben	
Total Expense Ratios	223
In Umlauf befindliche Aktien	238
Erläuterungen zum Abschluss	249
Anhänge	373

Kopien des Halbjahresberichts einschließlich des ungeprüften Abschlusses für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 sind am Sitz der BlueBay Funds Management Company S.A. (die „Verwaltungsgesellschaft“), 4, Boulevard Royal, L-2449 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg, erhältlich. Bekanntmachungen an die Aktionäre werden in einer Luxemburger Tageszeitung sowie, falls erforderlich, im *Mémorial C, Recueil des Sociétés et Associations* veröffentlicht. Die Satzung der Société d'Investissement à Capital Variable („SICAV“) wurde bei der Hauptregisterstelle des Bezirksgerichts Luxemburg („Greffier en chef du Tribunal d'Arrondissement de et à Luxembourg“) hinterlegt, wo sie eingesehen werden kann und auf Anfrage kostenlos Kopien ausgehändigt werden. Der Nettoinventarwert je Aktie der Teilfonds der SICAV wird in der *Financial Times* veröffentlicht. Die Ausgabe- und Rücknahmepreise sind am eingetragenen Sitz der SICAV oder bei RBC Global Asset Management (UK) Limited, 100, Bishopsgate, London, EC2N 4AA, Vereinigtes Königreich, erhältlich.

Auf der Grundlage dieses Berichts darf keine Zeichnung entgegengenommen werden. Die Zeichnungen erfolgen nur auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospektes und des letzten veröffentlichten Jahresberichts einschließlich des geprüften Abschlusses oder, falls danach ein Halbjahresbericht veröffentlicht wurde, auf der Grundlage dieses Halbjahresberichts.

Es ist zu beachten, dass die vergangene Performance keinen Anhaltspunkt für die zukünftige Performance bietet und dass sie eventuell nicht wieder erreicht wird. Der Wert von Anlagen und der mit ihnen erzielte Ertrag können sich sowohl verringern als auch erhöhen und es ist daher möglich, dass Anleger nicht den gleichen Betrag zurück erhalten, den sie investiert haben. Deshalb können Anleger nicht sicher sein, mit ihren Anlagen einen Gewinn zu erzielen, und es besteht die Möglichkeit, dass sie Geld verlieren.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Geschäftsführung und Verwaltung

Verwaltungsgesellschaft

BlueBay Funds Management Company S.A.
4, Boulevard Royal
L-2449 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

R.C.S. Nr. B 88 445

Anlageverwalter und -berater

RBC Global Asset Management (UK) Limited
(bis 3. Juli 2023)
77 Grosvenor Street
London, W1K 3JR
Vereinigtes Königreich

RBC Global Asset Management (UK) Limited
(seit 3. Juli 2023)
100, Bishopsgate
London, EC2N 4AA
Vereinigtes Königreich

Weltweite Vertriebsgesellschaft

BlueBay Funds Management Company S.A.
4, Boulevard Royal
L-2449 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Unteranlageverwalter und -berater*

RBC Global Asset Management (U.S.) Inc.
50 South Sixth Street
Suite 2350, Minneapolis, MN 55402
Vereinigte Staaten von Amerika

Depotstelle, Administrationsstelle, Hauptverwaltung, Zahl-, Register-, Transfer- und Notierungsstelle

Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.
80, route d'Esch
L-1470 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Zahlstelle in Italien

State Street Bank International GmbH – Succursale Italia
Via Ferrante Aporti, 10
20125 Mailand
Italien

Abschlussprüfer der SICAV

PricewaterhouseCoopers, *Société coopérative*
2, rue Gerhard Mercator B.P. 1443
L-1014 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Abschlussprüfer der Verwaltungsgesellschaft

PricewaterhouseCoopers, *Société coopérative*
2, rue Gerhard Mercator B.P. 1443
L-1014 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Rechtsberater

Arendt & Medernach S.A.
41A, avenue J.F. Kennedy
L-2082 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Verwaltungsrat der SICAV

Henry Kelly

(bis 27. Oktober 2023)
Großherzogtum Luxemburg

Tracey McDermott

(seit 27. Oktober 2023)
Großherzogtum Luxemburg

Nicholas Williams

Vereinigtes Königreich

Luigi Passamonti

Österreich

William Jones

Großherzogtum Luxemburg

* RBC Global Asset Management (U.S.) Inc. fungiert als Unteranlageverwalter und -berater für den BlueBay Funds – BlueBay High Yield ESG Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund, BlueBay Funds – BlueBay Financial Capital Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Structured Credit Fund, BlueBay Funds – BlueBay High Grade Structured Credit Short Duration Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade ESG Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Impact-Aligned Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Government Bond Fund und BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Financials Plus Bond Fund.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Geschäftsführung und Verwaltung (Fortsetzung)

Verwaltungsrat der SICAV (Fortsetzung)

Constantine Knox
Vereinigtes Königreich

Neil Sills
Vereinigtes Königreich

Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft

Francis Kass
41A, avenue J.F. Kennedy
L-2082 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Terrence Alfred Farrelly
(bis 8. August 2023)
4, Boulevard Royal
L-2449 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Lucian Orlovius
(bis 11. Dezember 2023)
4, Boulevard Royal
L-2449 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Christopher Wiksyk
100, Bishopsgate
London, EC2N 4AA
Vereinigtes Königreich

Heidi Gunkel
(seit 8. August 2023)
100, Bishopsgate
London, EC2N 4AA
Vereinigtes Königreich

Adil Chaudhry
(seit 8. August 2023)
16, rue Notre Dame
L-2240 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Hervé Leite-Faria
(seit 11. Dezember 2023)
4, Boulevard Royal
L-2449 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Geschäftsführer der Verwaltungsgesellschaft

Hervé Leite-Faria
4, Boulevard Royal
L-2449 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Cédric Verhoeye
4, Boulevard Royal
L-2449 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Anne-Cécile Pirard
4, Boulevard Royal
L-2449 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Lucian Orlovius
(bis 11. Dezember 2023)
4, Boulevard Royal
L-2449 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Marta Nestorowicz
4, Boulevard Royal
L-2449 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Anne-Sophie Girault
(seit 11. Dezember 2023)
4, Boulevard Royal
L-2449 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Zusammenfassung der Anlageziele der Teilfonds

Das zugrunde liegende Anlageziel jedes Teilfonds besteht darin, mittelfristig einen hohen Gesamtertrag zu erzielen, der sich aus Einkommen und Vermögenszuwachs zusammensetzt. Jeder Teilfonds strebt danach, in Übereinstimmung mit den spezifischen Anlagegrundsätzen, die vom Verwaltungsrat der SICAV für den Teilfonds festgelegt wurden, dieses Ziel zu erreichen. Die Teilfonds investieren daher hauptsächlich in festverzinsliche Wertpapiere, bei denen der Anlageverwalter und -berater davon ausgeht, dass sie potenziell einen höheren Gesamtertrag erbringen.

Der nachstehende Text fasst die Anlageziele der folgenden BlueBay-Fonds zusammen: BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay High Yield ESG Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Select Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Global Convertible Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund, BlueBay Funds – BlueBay Financial Capital Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund, BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Structured Credit Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay High Grade Structured Credit Short Duration Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade ESG Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Impact-Aligned Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Government Bond Fund und BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Financials Plus Bond Fund (jeder ein „Teilfonds“, gemeinsam die „Teilfonds“). Eine detaillierte Beschreibung der Anlageziele, Anlagerichtlinien und Anlagebeschränkungen der Teilfonds sind im Verkaufsprospekt der BlueBay Funds enthalten.

1. BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund

Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin, durch Anlage in einem Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren von Emittenten aus Schwellenländern einen Gesamtertrag zu erzielen, der über dem des JP Morgan Emerging Market Bond Index Global Diversified („EMBI Global Diversified“) liegt. Es bestehen keine Einschränkungen, inwieweit das Portfolio und die Performance des Teilfonds von denen der Benchmark abweichen können. Der Anlageverwalter verfügt im Rahmen des Anlageprozesses über ein uneingeschränktes Ermessen hinsichtlich der Zusammensetzung des Portfolios des Teilfonds, und er kann ein Engagement in Unternehmen, Ländern oder Sektoren eingehen, die nicht in der Benchmark enthalten sind.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert der Teilfonds mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens in festverzinsliche Wertpapiere mit beliebigem Rating, die von Emittenten aus Schwellenländern begeben werden. Der Teilfonds investiert in auf USD und andere Währungen lautende Wertpapiere, einschließlich Wertpapieren, die auf die lokalen Währungen der Schwellenländer lauten, in denen der Teilfonds anlegt. Der Prozentsatz der nicht auf USD lautenden Wertpapiere kann im Laufe der Zeit ansteigen, um Marktchancen und die Zusammensetzung des Referenzindex widerzuspiegeln.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren von Emittenten aus Schwellenländern anlegen möchten.

2. BlueBay Funds – BlueBay High Yield ESG Bond Fund

Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin, durch Anlage in einem Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren und unter Berücksichtigung von ESG-Aspekten einen Gesamtertrag zu erzielen, der über dem des ICE Bank of America Merrill Lynch European Currency High Yield Constrained Index (vollständig gegenüber dem EUR abgesichert) liegt. Es bestehen keine Einschränkungen, inwieweit das Portfolio und die Performance des Teilfonds von denen der Benchmark abweichen können. Der Anlageverwalter verfügt im Rahmen des Anlageprozesses über ein uneingeschränktes Ermessen hinsichtlich der Zusammensetzung des Portfolios des Teilfonds, und er kann ein Engagement in Unternehmen, Ländern oder Sektoren eingehen, die nicht in der Benchmark enthalten sind.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Zusammenfassung der Anlageziele der Teilfonds (Fortsetzung)

2. BlueBay Funds – BlueBay High Yield ESG Bond Fund (Fortsetzung)

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert der Teilfonds mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens in festverzinsliche Wertpapiere mit Ratings unterhalb von „Investment Grade“. Der Teilfonds kann bis zu einem Drittel seines Nettovermögens in festverzinslichen Wertpapieren mit „Investment Grade“-Rating anlegen. In der Regel werden mindestens 50% seines Nettovermögens in festverzinsliche Wertpapiere investiert. Diese festverzinslichen Wertpapiere müssen von Unternehmen begeben werden, die ihren Sitz in europäischen Ländern haben, deren langfristige Staatsanleihen mit „Investment Grade“ bewertet werden. Sie können ferner von Unternehmen außerhalb dieser Länder begeben werden, sofern der Emittent ein Mutterunternehmen in einem europäischen Land hat, dessen langfristige Staatsanleihen mit „Investment Grade“ bewertet werden. Des Weiteren erfolgt die Anlage in notleidenden Schuldpapieren. Mindestens zwei Drittel des Nettovermögens des Teilfonds lauten auf Währungen der Länder der Europäischen Union und des Vereinigten Königreichs. Der Teilfonds kann bis zu einem Drittel seines Nettovermögens in Wertpapiere investieren, die auf Währungen anderer Länder lauten, deren langfristige Staatsanleihen mit „Investment Grade“ bewertet sind.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren vornehmlich von Emittenten aus dem High-Yield-Sektor anlegen möchten.

3. BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund

Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin, durch Anlage in einem Portfolio aus mit „Investment Grade“ bewerteten festverzinslichen Wertpapieren und unter Berücksichtigung von ESG-Aspekten einen Gesamtertrag zu erzielen, der über dem des iBoxx Euro Corporates Index liegt. Es bestehen keine Einschränkungen, inwieweit das Portfolio und die Performance des Teilfonds von denen der Benchmark abweichen können. Der Anlageverwalter verfügt im Rahmen des Anlageprozesses über ein uneingeschränktes Ermessen hinsichtlich der Zusammensetzung des Portfolios des Teilfonds, und er kann ein Engagement in Unternehmen, Ländern oder Sektoren eingehen, die nicht in der Benchmark enthalten sind.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert der Teilfonds mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens in festverzinsliche Wertpapiere mit „Investment Grade“-Rating, die von Unternehmen begeben werden, die ihren Sitz in europäischen Ländern haben, deren langfristige Staatsanleihen mit „Investment Grade“ bewertet sind. Der Teilfonds kann bis zu einem Drittel seines Nettovermögens in mit „Investment Grade“ bewertete festverzinsliche Wertpapiere investieren, die von Unternehmen begeben werden, die in Ländern außerhalb Europas ansässig sind und deren langfristige Staatsanleihen mit „Investment Grade“ bewertet sind. Der Teilfonds kann bis zu 15% seines Nettovermögens in festverzinslichen Wertpapieren anlegen, die mit Ratings unterhalb von „Investment Grade“ bewertet sind, sofern diese Wertpapiere kein Rating unterhalb von B-/B3 aufweisen. Mindestens zwei Drittel des Nettovermögens des Teilfonds lauten auf Währungen der Länder der Europäischen Union und des Vereinigten Königreichs. Der Teilfonds kann bis zu einem Drittel seines Nettovermögens in Wertpapiere investieren, die auf Währungen anderer Länder lauten, deren langfristige Staatsanleihen mit „Investment Grade“ bewertet sind.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren mit „Investment Grade“-Rating anlegen möchten.

4. BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund

Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin, durch Anlage in einem Portfolio aus festverzinslichen, hauptsächlich auf Lokalwährungen lautenden Staatsanleihen von Emittenten aus Schwellenländern einen Gesamtertrag zu erzielen, der über dem des JP Morgan Government Bond Index – Emerging Markets Global Diversified („GBI-EM Global Diversified“) (ohne Absicherung gegenüber dem USD) liegt. Es bestehen keine Einschränkungen, inwieweit das Portfolio und die Performance des Teilfonds von denen der Benchmark abweichen können. Der Anlageverwalter verfügt im Rahmen des Anlageprozesses über ein uneingeschränktes Ermessen hinsichtlich der Zusammensetzung des Portfolios des Teilfonds, und er kann ein Engagement in Unternehmen, Ländern oder Sektoren eingehen, die nicht in der Benchmark enthalten sind.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert der Teilfonds mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens in festverzinsliche Staatsanleihen mit beliebigem Rating, die von Regierungen von Schwellenländern begeben werden und auf lokale Währung lauten, sowie in notleidende Schuldpapiere, die von Regierungen von Schwellenländern begeben werden und auf lokale Währung lauten. Diese Anlagen können Anleihen staatlicher Emittenten umfassen, die in lokalen Währungen gehandelt werden, sowie Anleihen und Schuldverschreibungen von Banken und Unternehmen, die an den lokalen Märkten gehandelt werden. Voraussichtlich werden die meisten Anlagen in Staatsanleihen getätigt werden. Der Teilfonds kann bis zu einem Drittel seines Nettovermögens in festverzinsliche, nicht auf lokale Währungen lautende Wertpapiere von Emittenten aus Schwellenländern sowie in festverzinsliche Wertpapiere staatlicher Emittenten aus Nicht-Schwellenländern investieren.

Zusammenfassung der Anlageziele der Teilfonds (Fortsetzung)

4. BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund (Fortsetzung)

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus festverzinslichen, auf lokale Währungen lautenden Staatsanleihen von Emittenten aus Schwellenländern anlegen möchten.

5. BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Select Bond Fund

Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin, eine Gesamtertragsrendite zu erzielen, die über der des zusammengesetzten Index aus 50% JP Morgan Emerging Market Bond Index Global Diversified („EMBI Global Diversified“) und 50% JP Morgan Government Bond Index – Emerging Markets Global Diversified („GBI-EM Global Diversified“) (ohne Absicherung gegenüber dem USD) liegt. Es bestehen keine Einschränkungen, inwieweit das Portfolio und die Performance des Teilfonds von denen der Benchmark abweichen können. Der Anlageverwalter verfügt im Rahmen des Anlageprozesses über ein uneingeschränktes Ermessen hinsichtlich der Zusammensetzung des Portfolios des Teilfonds, und er kann ein Engagement in Unternehmen, Ländern oder Sektoren eingehen, die nicht in der Benchmark enthalten sind.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert der Teilfonds in festverzinsliche Wertpapiere, die von Emittenten aus Schwellenländern begeben werden und auf beliebige Währungen lauten. Der Teilfonds investiert mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens in festverzinsliche Wertpapiere mit beliebigem Rating, die von Emittenten aus Schwellenländern begeben wurden und auf beliebige Währungen lauten können, sowie in notleidende Schuldpapiere von Emittenten aus Schwellenländern. Der Teilfonds investiert aktiv in Vermögenswerte, die auf harte Währungen und lokale Währungen lauten. Der Teilfonds wird den Anteil des Vermögens, der in auf harte und lokale Währungen lautenden Anlageinstrumenten investiert ist, gemäß den Anlageüberzeugungen des Anlageverwalters bezüglich der entsprechenden Instrumente variieren, insbesondere was das Bonitätsrating, die Währung (ausschließlich im Falle von Vermögenswerten, die auf lokale Währung lauten) und den Zinssatz solcher Anlageinstrumente betrifft.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus festverzinslichen, auf beliebige Währungen lautenden Wertpapieren von Emittenten aus Schwellenländern anlegen möchten.

6. BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund

Das Anlageziel dieses Teilfonds besteht darin, durch Anlage in einem Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren von Unternehmen aus Schwellenländern einen Gesamtertrag zu erzielen, der über dem des JP Morgan Corporate Emerging Market Bond Index („CEMBI“) Diversified liegt. Es bestehen keine Einschränkungen, inwieweit das Portfolio und die Performance des Teilfonds von denen der Benchmark abweichen können. Der Anlageverwalter verfügt im Rahmen des Anlageprozesses über ein uneingeschränktes Ermessen hinsichtlich der Zusammensetzung des Portfolios des Teilfonds, und er kann ein Engagement in Unternehmen, Ländern oder Sektoren eingehen, die nicht in der Benchmark enthalten sind.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert der Teilfonds mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens in festverzinsliche Wertpapiere mit beliebigem Rating, die von Unternehmen mit Sitz in Schwellenländern begeben werden, sowie in Schuldpapiere ohne Rating und notleidende Schuldpapiere. Der Teilfonds investiert in auf USD und andere Währungen lautende Wertpapiere, einschließlich Wertpapieren, die auf die lokalen Währungen der Schwellenländer lauten, in denen der Teilfonds anlegt. Der Prozentsatz der nicht auf US-Dollar lautenden Wertpapiere kann im Laufe der Zeit ansteigen, um Marktchancen und die Zusammensetzung des Referenzindex widerzuspiegeln.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren von Emittenten aus Schwellenländern anlegen möchten.

7. BlueBay Funds – BlueBay Global Convertible Bond Fund

Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin, durch Anlage in einem Portfolio aus Wandelanleihen und unter Berücksichtigung von ESG-Aspekten einen Gesamtertrag zu erzielen, der über dem des Refinitiv Global Convertible Focus Index USD liegt. Es bestehen keine Einschränkungen, inwieweit das Portfolio und die Performance des Teilfonds von denen der Benchmark abweichen können. Der Anlageverwalter verfügt im Rahmen des Anlageprozesses über ein uneingeschränktes Ermessen hinsichtlich der Zusammensetzung des Portfolios des Teilfonds, und er kann ein Engagement in Unternehmen, Ländern oder Sektoren eingehen, die nicht in der Benchmark enthalten sind.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Zusammenfassung der Anlageziele der Teilfonds (Fortsetzung)

7. BlueBay Funds – BlueBay Global Convertible Bond Fund (Fortsetzung)

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert der Teilfonds mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens in Wandelanleihen, Optionsschuldverschreibungen oder sonstige wandelbare Finanzinstrumente nationaler oder internationaler Emittenten. Der Teilfonds kann bis zu einem Drittel seines Nettovermögens in fest- und variabel verzinsliche Wertpapiere (ausgenommen Umtauschrechte) sowie in Beteiligungspapiere, Aktienoptionen und Genussscheine investieren. Der Teilfonds investiert mindestens 50% seines Nettovermögens in Wertpapiere, die von Unternehmen aus der Europäischen Union und dem Vereinigten Königreich, Japan oder den USA begeben werden.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus Wandelanleihen anlegen möchten.

8. BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund

Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin, durch Anlage in einem Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren, die überwiegend von Emittenten aus Schwellenländern begeben wurden und auf beliebige Währungen lauten, sowie durch Anlagen, die direkt oder indirekt mit Währungen und/oder Zinssätzen von Schwellenländern verbunden sind, eine Gesamtrendite zu erzielen.

Um dieses Ziel zu erreichen, kann der Teilfonds in festverzinsliche Wertpapiere mit beliebigem Rating investieren. Der Teilfonds investiert in der Regel mindestens 50% seines Nettovermögens in festverzinsliche Wertpapiere, die von Emittenten aus Schwellenländern und sonstigen Emittenten mit einem bedeutenden Engagement in Schwellenländern begeben wurden und die auf beliebige Währungen lauten können, sowie in notleidende Schuldpapiere von Emittenten aus Schwellenländern. Mindestens 50% des Nettovermögens des Teilfonds entfallen auf Engagements in Anleihen und/oder Schuldtiteln staatlicher Emittenten aus Schwellenländern sowie in Währungen und Zinssätzen. Der Teilfonds kann diese Anlagen direkt halten oder ein entsprechendes Engagement über Finanzinstrumente aufbauen. Der Teilfonds investiert aktiv in Vermögenswerte, die auf harte Währungen und lokale Währungen lauten. Der Teilfonds wird den Anteil des Vermögens, der in auf harte und lokale Währungen lautenden Anlageinstrumenten investiert ist, gemäß den Anlageüberzeugungen des Anlageverwalters bezüglich der entsprechenden Instrumente variieren, insbesondere was die Bonität, die Währung (ausschließlich im Falle von Vermögenswerten, die auf lokale Währung lauten) und den Zinssatz solcher Anlageinstrumente betrifft.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittleren bis langfristigen Anlagehorizont (3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus festverzinslichen Anleihen und anderen Schuldtiteln anlegen möchten, die von Emittenten mit Sitz in Schwellenmärkten begeben werden oder sich auf diese beziehen und auf beliebige Währungen lauten, sowie in Anlagen, die direkt oder indirekt mit lokalen Währungen und Zinssätzen von Schwellenländern verbunden sind.

9. BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund

Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin, durch Anlage in einem Portfolio aus mit „Investment Grade“ bewerteten festverzinslichen Wertpapieren einen Gesamtertrag zu erzielen, der über dem des Bloomberg Euro Aggregate Treasury Index liegt. Es bestehen keine Einschränkungen, inwieweit das Portfolio und die Performance des Teilfonds von denen der Benchmark abweichen können. Der Anlageverwalter verfügt im Rahmen des Anlageprozesses über ein uneingeschränktes Ermessen hinsichtlich der Zusammensetzung des Portfolios des Teilfonds, und er kann ein Engagement in Unternehmen, Ländern oder Sektoren eingehen, die nicht in der Benchmark enthalten sind.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert der Teilfonds mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens in festverzinsliche Wertpapiere mit „Investment Grade“-Rating. Diese festverzinslichen Wertpapiere müssen von Unternehmen begeben werden, die ihren Sitz in Ländern der Europäischen Union oder dem Vereinigten Königreich haben, deren langfristige Staatsanleihen mit „Investment Grade“ bewertet werden. Der Teilfonds kann bis zu einem Drittel seines Nettovermögens in mit „Investment Grade“ bewertete festverzinsliche Wertpapiere investieren, die von Unternehmen begeben werden, die in Ländern außerhalb der Europäischen Union und des Vereinigten Königreichs ansässig sind, deren langfristige Staatsanleihen mit „Investment Grade“ bewertet werden. Der Teilfonds kann bis zu 15% seines Nettovermögens in festverzinslichen Wertpapieren anlegen, die mit Ratings unterhalb von „Investment Grade“ bewertet werden, sofern diese Wertpapiere kein Rating unterhalb von B-/B3 aufweisen. Mindestens zwei Drittel des Nettovermögens des Teilfonds lauten auf Währungen europäischer Länder.

Zusammenfassung der Anlageziele der Teilfonds (Fortsetzung)

9. BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund (Fortsetzung)

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren mit „Investment Grade“-Rating anlegen möchten.

10. BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund

Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin, durch Anlage in einem Portfolio aus mit „Investment Grade“ bewerteten festverzinslichen Wertpapieren und unter Berücksichtigung von ESG-Aspekten eine Gesamtertragsrate zu erzielen, die über der des Bloomberg Euro Aggregate Index liegt. Es bestehen keine Einschränkungen, inwieweit das Portfolio und die Performance des Teilfonds von denen der Benchmark abweichen können. Der Anlageverwalter verfügt im Rahmen des Anlageprozesses über ein uneingeschränktes Ermessen hinsichtlich der Zusammensetzung des Portfolios des Teilfonds, und er kann ein Engagement in Unternehmen, Ländern oder Sektoren eingehen, die nicht in der Benchmark enthalten sind.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert der Teilfonds mindestens zwei Drittel seines gesamten Nettovermögens in festverzinsliche Wertpapiere mit „Investment Grade“-Rating. Diese festverzinslichen Wertpapiere müssen von Unternehmen begeben werden, die ihren Sitz in Ländern der Europäischen Union oder dem Vereinigten Königreich haben, deren langfristige Staatsanleihen mit „Investment Grade“ bewertet werden. Der Teilfonds kann bis zu einem Drittel seines Nettovermögens in mit „Investment Grade“ bewertete festverzinsliche Wertpapiere investieren, die von Unternehmen begeben werden, die in Ländern außerhalb der Europäischen Union und des Vereinigten Königreichs ansässig sind, deren langfristige Staatsanleihen mit „Investment Grade“ bewertet werden. Der Teilfonds kann bis zu 15% seines Nettovermögens in festverzinslichen Wertpapieren anlegen, die mit Ratings unterhalb von „Investment Grade“ bewertet werden, sofern diese Wertpapiere kein Rating unterhalb von B-/B3 aufweisen. Mindestens zwei Drittel des Nettovermögens des Teilfonds lauten auf Währungen europäischer Länder.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren mit „Investment Grade“-Rating anlegen möchten.

11. BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund

Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin, durch Anlage in einem weltweiten Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren einen Gesamtertrag zu erzielen, der über dem des ICE Bank of America Merrill Lynch Global High Yield Constrained Index (vollständig gegenüber dem USD abgesichert) liegt. Es bestehen keine Einschränkungen, inwieweit das Portfolio und die Performance des Teilfonds von denen der Benchmark abweichen können. Der Anlageverwalter verfügt im Rahmen des Anlageprozesses über ein uneingeschränktes Ermessen hinsichtlich der Zusammensetzung des Portfolios des Teilfonds, und er kann ein Engagement in Unternehmen, Ländern oder Sektoren eingehen, die nicht in der Benchmark enthalten sind.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert der Teilfonds mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens in fest- und variabel verzinsliche, vorrangige und nachrangige Schuldverschreibungen von Unternehmen mit Ratings unterhalb von „Investment Grade“. Mindestens 50% des Nettovermögens des Teilfonds werden in Wertpapieren angelegt, die von Unternehmen mit Sitz in den USA begeben werden. Darüber hinaus kann der Teilfonds (i) bis zu 20% seines Nettovermögens in Wertpapieren anlegen, die von Unternehmen mit Sitz in Lateinamerika (Mexiko, Mittelamerika, Südamerika und Karibikinseln, einschließlich Puerto Rico) begeben werden, und (ii) bis zu 20% seines Nettovermögens in Wertpapieren, die von Unternehmen mit Sitz in Asien (dem asiatischen Kontinent und den umgebenden Pazifikinseln einschließlich Australien und Neuseeland) begeben werden.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren vornehmlich von Emittenten aus dem High-Yield-Sektor anlegen möchten.

12. BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund

Das Anlageziel dieses Teilfonds besteht darin, einen Gesamtertrag zu erzielen, der über dem des JP Morgan Corporate Emerging Market Diversified High Grade Index liegt. Es bestehen keine Einschränkungen, inwieweit das Portfolio und die Performance des Teilfonds von denen der Benchmark abweichen können. Der Anlageverwalter verfügt im Rahmen des Anlageprozesses über ein uneingeschränktes Ermessen hinsichtlich der Zusammensetzung des Portfolios des Teilfonds, und er kann ein Engagement in Unternehmen, Ländern oder Sektoren eingehen, die nicht in der Benchmark enthalten sind.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Zusammenfassung der Anlageziele der Teilfonds (Fortsetzung)

12. BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund (Fortsetzung)

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert der Teilfonds mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens in festverzinsliche Wertpapiere mit „Investment Grade“-Rating, die von Unternehmen mit Sitz in einem Schwellenland begeben werden. Der Teilfonds kann bis zu 15% seines Nettovermögens in festverzinslichen Wertpapieren anlegen, die mit Ratings unterhalb von „Investment Grade“ bewertet werden, sofern diese Wertpapiere kein Rating unterhalb von B-/B3 aufweisen.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren mit „Investment Grade“-Rating anlegen möchten und Preisschwankungen hinnehmen können.

13. BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund

Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin, durch Anlage in einem Portfolio aus mit „Investment Grade“ bewerteten festverzinslichen Wertpapieren und unter Berücksichtigung von ESG-Aspekten eine Gesamtertragsrate zu erzielen, die über jener des ICE Bank of America Merrill Lynch Euro Currency 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index liegt. Es bestehen keine Einschränkungen, inwieweit das Portfolio und die Performance des Teilfonds von denen der Benchmark abweichen können. Der Anlageverwalter verfügt im Rahmen des Anlageprozesses über ein uneingeschränktes Ermessen hinsichtlich der Zusammensetzung des Portfolios des Teilfonds, und er kann ein Engagement in Unternehmen, Ländern oder Sektoren eingehen, die nicht in der Benchmark enthalten sind.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert der Teilfonds mindestens 50% seines Nettovermögens in festverzinsliche Wertpapiere mit „Investment Grade“-Rating.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren mit „Investment Grade“-Rating anlegen möchten.

14. BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund

Das Anlageziel dieses Teilfonds besteht darin, einen Gesamtertrag zu erzielen, der über dem des JP Morgan Corporate Emerging Market Diversified High Yield Index liegt. Es bestehen keine Einschränkungen, inwieweit das Portfolio und die Performance des Teilfonds von denen der Benchmark abweichen können. Der Anlageverwalter verfügt im Rahmen des Anlageprozesses über ein uneingeschränktes Ermessen hinsichtlich der Zusammensetzung des Portfolios des Teilfonds, und er kann ein Engagement in Unternehmen, Ländern oder Sektoren eingehen, die nicht in der Benchmark enthalten sind.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert der Teilfonds mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens in festverzinsliche Wertpapiere, die Ratings unterhalb von „Investment Grade“ aufweisen und von Unternehmen mit Sitz in einem Schwellenland begeben werden. Der Teilfonds kann außerdem in notleidenden Schuldpapieren anlegen.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren von Emittenten aus Schwellenländern anlegen möchten.

15. BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund

Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin, durch Anlage in einem Portfolio aus mit „Investment Grade“ bewerteten festverzinslichen Wertpapieren und unter Berücksichtigung von ESG-Aspekten einen Gesamtertrag zu erzielen, der über dem des Bloomberg Global Aggregate Corporates Bond Index USD Hedged liegt. Es bestehen keine Einschränkungen, inwieweit das Portfolio und die Performance des Teilfonds von denen der Benchmark abweichen können. Der Anlageverwalter verfügt im Rahmen des Anlageprozesses über ein uneingeschränktes Ermessen hinsichtlich der Zusammensetzung des Portfolios des Teilfonds, und er kann ein Engagement in Unternehmen, Ländern oder Sektoren eingehen, die nicht in der Benchmark enthalten sind.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert der Teilfonds mindestens 65% seines Nettovermögens in festverzinsliche Wertpapiere mit „Investment Grade“-Rating.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren mit „Investment Grade“-Rating anlegen möchten.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Zusammenfassung der Anlageziele der Teilfonds (Fortsetzung)

16. BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund

Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin, bei der Anlage in festverzinslichen Anlagekategorien mit höherer Verzinsung durch eine aktive Titelauswahl und Vermögensallokation sowie Techniken der Kapitalerhaltung unter Berücksichtigung von ESG-Aspekten eine Gesamrendite zu erzielen.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert der Teilfonds sein Nettovermögen überwiegend in fest- und variabel verzinsliche, vorrangige und nachrangige Wertpapiere von Unternehmen und staatlichen Emittenten (einschließlich Emittenten aus Schwellenländern). Der Teilfonds kann in festverzinslichen Wertpapieren mit beliebigem Rating, in Wertpapieren ohne Rating und in notleidenden Schuldpapieren anlegen. Der Teilfonds kann bis zu 25% seines Nettovermögens in Wandelanleihen, Optionsschuldverschreibungen oder sonstige wandelbare Finanzinstrumente anlegen, die von Unternehmen weltweit begeben worden. Der Teilfonds kann bis zu 20% seines Nettovermögens in strukturierten Kreditinstrumenten anlegen. Der Teilfonds investiert in auf USD und andere Währungen lautende Wertpapiere, einschließlich Wertpapieren, die auf die Lokalwährungen der Schwellenländer lauten, in denen der Teilfonds anlegt. Falls der Anlageverwalter dies für angemessen hält, kann der Teilfonds gelegentlich bis zu 50% seines Nettovermögens in Barmitteln halten.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die durch ein Engagement in einem weiten Spektrum aus festverzinslichen Wertpapieren eine Gesamrendite erzielen möchten.

17. BlueBay Funds – BlueBay Financial Capital Bond Fund

Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin, durch Anlage in einem Portfolio aus nachrangigen, von Finanzinstituten begebenen Schuldtiteln und unter Berücksichtigung von ESG-Aspekten einen Gesamtertrag zu erzielen.

Der Teilfonds investiert mindestens 50% seines Nettovermögens in nachrangige Schuldtitel, die von Finanzinstituten begeben werden. Zu den nachrangigen Schuldtiteln gehören insbesondere Tier 1- und Tier 2-CoCo-Bonds und unbefristete US-Vorzugsaktien.

Der Teilfonds kann in festverzinslichen Wertpapieren mit beliebigem Rating, in Wertpapieren ohne Rating und in notleidenden Schuldpapieren anlegen.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus nachrangigen Schuldtiteln anlegen möchten, die von Finanzinstituten begeben werden.

18. BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund

Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin, durch Anlage in einem Portfolio aus mit „Investment Grade“ bewerteten festverzinslichen Wertpapieren und unter Berücksichtigung von ESG-Aspekten einen Gesamtertrag zu erzielen, der über dem des Bloomberg Global Aggregate Bond Index USD unhedged liegt. Es bestehen keine Einschränkungen, inwieweit das Portfolio und die Performance des Teilfonds von denen der Benchmark abweichen können. Der Anlageverwalter verfügt im Rahmen des Anlageprozesses über ein uneingeschränktes Ermessen hinsichtlich der Zusammensetzung des Portfolios des Teilfonds, und er kann ein Engagement in Unternehmen, Ländern oder Sektoren eingehen, die nicht in der Benchmark enthalten sind.

Der Teilfonds investiert mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens in fest- und variabel verzinsliche Wertpapiere mit „Investment Grade“-Rating, die von staatlichen Emittenten und Unternehmen weltweit (einschließlich Emittenten aus Schwellenländern) begeben werden. Der Teilfonds kann bis zu 15% seines Nettovermögens in festverzinslichen Wertpapieren anlegen, die mit Ratings unterhalb von „Investment Grade“ bewertet werden, sofern diese Wertpapiere kein Rating unterhalb von B-/B3 aufweisen.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren anlegen möchten.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Zusammenfassung der Anlageziele der Teilfonds (Fortsetzung)

19. BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund

Das Anlageziel dieses Teilfonds besteht darin, durch Anlage in einem Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren von Unternehmen mit Sitz in Schwellenländern einen Gesamtertrag zu erzielen, der über der des zusammengesetzten Index aus 50% JP Morgan Emerging Market Bond Index Global Diversified und 50% JP Morgan Corporate Emerging Market Bond Index (CEMBI) Diversified liegt. Es bestehen keine Einschränkungen, inwieweit das Portfolio und die Performance des Teilfonds von denen der Benchmark abweichen können. Der Anlageverwalter verfügt im Rahmen des Anlageprozesses über ein uneingeschränktes Ermessen hinsichtlich der Zusammensetzung des Portfolios des Teilfonds, und er kann ein Engagement in Unternehmen, Ländern oder Sektoren eingehen, die nicht in der Benchmark enthalten sind.

Der Teilfonds investiert mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens in festverzinsliche Wertpapiere mit beliebigem Rating, die von Unternehmen mit Sitz in Schwellenländern begeben werden. Der Teilfonds kann außerdem in Wertpapieren ohne Bonitätsrating und in notleidenden Schuldpapieren anlegen.

Der Teilfonds investiert in auf harte Währungen lautende Wertpapiere, aber nicht in Wertpapiere, die auf lokale Währungen der Schwellenländer lauten.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren von Emittenten aus Schwellenländern anlegen möchten.

20. BlueBay Funds – BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund

Das Anlageziel dieses Teilfonds besteht darin, aus einem Portfolio globaler Staatsanleihen (einschließlich Schwellenländer) durch aktives Zins-, Kredit- und Währungsmanagement und unter Berücksichtigung von ESG-Aspekten einen Gesamtertrag zu erzielen.

Der Teilfonds investiert sein Nettovermögen in globale festverzinsliche Wertpapiere staatlicher Emittenten aus aller Welt (einschließlich der Schwellenländer). Außerdem beabsichtigt der Teilfonds, die Auffassungen des Anlageverwalters zu Zinssätzen, Krediten und Währungen durch den aktiven Einsatz derivativer Instrumente umzusetzen. Der Teilfonds investiert in auf USD und andere Währungen lautende Wertpapiere, einschließlich Wertpapiere, die auf lokale Währungen lauten. Der Teilfonds investiert mindestens 50% seines Nettovermögens in festverzinsliche Wertpapiere mit „Investment Grade“-Rating.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren anlegen möchten, das Long- und Short-Positionen durch den Einsatz von Finanzderivaten zu Zinssätzen, Krediten und Währungen eingeht.

21. BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund

Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin, durch Anlage in einem weltweiten Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren und unter Berücksichtigung von ESG-Aspekten einen Gesamtertrag zu erzielen, der über dem des ICE BofA Merrill Lynch Global High Yield Investment Grade Countries Index (vollständig gegenüber dem USD abgesichert) liegt. Es bestehen keine Einschränkungen, inwieweit das Portfolio und die Performance des Teilfonds von denen der Benchmark abweichen können. Der Anlageverwalter verfügt im Rahmen des Anlageprozesses über ein uneingeschränktes Ermessen hinsichtlich der Zusammensetzung des Portfolios des Teilfonds, und er kann ein Engagement in Unternehmen, Ländern oder Sektoren eingehen, die nicht in der Benchmark enthalten sind.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert der Teilfonds mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens in fest- und variabel verzinsliche, vorrangige und nachrangige Schuldtitel von Unternehmen mit Ratings unterhalb von „Investment Grade“. Mindestens 50% des Nettovermögens des Teilfonds werden in Wertpapieren angelegt, die von Unternehmen mit Sitz in den USA begeben werden. Darüber hinaus kann der Teilfonds (i) bis zu 20% seines Nettovermögens in Wertpapieren anlegen, die von Unternehmen mit Sitz in Lateinamerika (Mexiko, Mittelamerika, Südamerika und Karibikinseln, einschließlich Puerto Rico) begeben werden, und (ii) bis zu 20% seines Nettovermögens in Wertpapieren, die von Unternehmen mit Sitz in Asien (dem asiatischen Kontinent und den umgebenden Pazifikinseln einschließlich Australien und Neuseeland) begeben werden.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren vornehmlich von Emittenten aus dem High-Yield-Sektor anlegen möchten.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Zusammenfassung der Anlageziele der Teilfonds (Fortsetzung)

22. BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Structured Credit Fund

Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin, durch Anlage in einem Portfolio aus strukturierten Kreditinstrumenten eine Gesamrendite zu erzielen, die über jener des ICE BofA Merrill Lynch Euro Currency 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index liegt. Es bestehen keine Einschränkungen, inwieweit das Portfolio und die Performance des Teilfonds von denen der Benchmark abweichen können. Der Anlageverwalter verfügt im Rahmen des Anlageprozesses über ein uneingeschränktes Ermessen hinsichtlich der Zusammensetzung des Portfolios des Teilfonds, und er kann ein Engagement in Unternehmen, Ländern oder Sektoren eingehen, die nicht in der Benchmark enthalten sind.

Der Teilfonds investiert mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens in strukturierte Kreditinstrumente aus aller Welt. Der Teilfonds kann bis zu einem Drittel seines Nettovermögens in andere fest- und variabel verzinsliche Wertpapiere investieren, die von staatlichen Emittenten und Unternehmen weltweit (einschließlich Emittenten aus Schwellenländern) begeben werden. Der Teilfonds kann bis zu 30% seines Nettovermögens in strukturierten Kreditinstrumenten und anderen festverzinslichen Wertpapieren anlegen, die mit Ratings unterhalb von „Investment Grade“ bewertet werden, sofern diese Wertpapiere kein Rating von Standards & Poor's oder Fitch unterhalb von B- bzw. kein Rating von Moody's unterhalb von B3 oder ein vergleichbares Rating einer anderen anerkannten Ratingagentur aufweisen.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus strukturierten Kreditinstrumenten anlegen möchten.

23. BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund

Das Anlageziel dieses Teilfonds besteht darin, durch Anlage in einem Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren mit kurzer Duration von Unternehmen mit Sitz in Schwellenländern einen Gesamtertrag zu erzielen, der über dem des JP Morgan Emerging Market Blend Hard Currency Credit 50-50 1-3 year Index liegt. Es bestehen keine Einschränkungen, inwieweit das Portfolio und die Performance des Teilfonds von denen der Benchmark abweichen können. Der Anlageverwalter verfügt im Rahmen des Anlageprozesses über ein uneingeschränktes Ermessen hinsichtlich der Zusammensetzung des Portfolios des Teilfonds, und er kann ein Engagement in Unternehmen, Ländern oder Sektoren eingehen, die nicht in der Benchmark enthalten sind.

Der Teilfonds investiert mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens in festverzinsliche Wertpapiere mit kurzer Duration und beliebigem Rating, die von Unternehmen mit Sitz in Schwellenländern begeben werden. Der Teilfonds kann außerdem in Wertpapieren ohne Bonitätsrating und in notleidenden Schuldpapieren anlegen. Die gewichtete Zinsduration des Teilfonds wird voraussichtlich in der Regel 1 bis 3 Jahre betragen.

Der Teilfonds investiert in auf harte Währungen lautende Wertpapiere, aber nicht in Wertpapiere, die auf lokale Währungen der Schwellenländer lauten.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren von Emittenten aus Schwellenländern anlegen möchten.

24. BlueBay Funds – BlueBay High Grade Structured Credit Short Duration Fund

Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin, durch Anlage in einem Portfolio aus strukturierten Kreditinstrumenten eine Gesamrendite zu erzielen, die über jener des ICE BofA Merrill Lynch Euro Currency 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index liegt. Es bestehen keine Einschränkungen, inwieweit das Portfolio und die Performance des Teilfonds von denen der Benchmark abweichen können. Der Anlageverwalter verfügt im Rahmen des Anlageprozesses über ein uneingeschränktes Ermessen hinsichtlich der Zusammensetzung des Portfolios des Teilfonds, und er kann ein Engagement in Unternehmen, Ländern oder Sektoren eingehen, die nicht in der Benchmark enthalten sind.

Der Teilfonds investiert mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens in strukturierte Kreditinstrumente aus aller Welt mit einem Schwerpunkt auf Collateralized Loan Obligations („CLOs“), durch Hypotheken auf Wohnimmobilien besicherten Wertpapieren („MBS“) und mit Forderungen aus Verbraucher- und Autokrediten besicherten Wertpapieren („ABS“). Der Teilfonds kann bis zu einem Drittel seines Nettovermögens in andere fest- und variabel verzinsliche Wertpapiere investieren, die von staatlichen Emittenten und Unternehmen weltweit begeben werden. Die gewichtete Kreditspread-Duration des Teilfonds wird in der Regel weniger als 3 Jahre betragen.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Zusammenfassung der Anlageziele der Teilfonds (Fortsetzung)

24. BlueBay Funds – BlueBay High Grade Structured Credit Short Duration Fund (Fortsetzung)

Der Teilfonds darf nur in strukturierten Kreditinstrumenten und anderen festverzinslichen Wertpapieren anlegen, die mit mindestens A- von Standard & Poor's oder Fitch oder mit mindestens A3 von Moody's bewertet werden, oder ein vergleichbares Rating einer anderen anerkannten Ratingagentur aufweisen, wie vom Anlageverwalter mitunter nach vernünftigem Ermessen festgelegt. Für die Zwecke aller Kreditratings gilt, dass in Fällen unterschiedlicher Ratings das höchste Rating berücksichtigt wird.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus strukturierten Kreditinstrumenten anlegen möchten.

25. BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade ESG Bond Fund

Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin, durch Anlage in einem Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren mit „Investment Grade“-Rating und unter Berücksichtigung von ESG-Aspekten eine Gesamtertragsrendite zu erzielen, die über jener des iBoxx Euro Corporates Index liegt.

Der Teilfonds investiert mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens in festverzinsliche Wertpapiere mit „Investment Grade“-Rating, die von Unternehmen begeben werden, die ihren Sitz in europäischen Ländern haben, deren langfristige Staatsanleihen mit „Investment Grade“ bewertet werden. Der Teilfonds kann bis zu ein Drittel seines Nettovermögens in mit „Investment Grade“ bewertete festverzinsliche Wertpapiere investieren, die von Unternehmen begeben werden, die in Ländern außerhalb Europas ansässig sind, deren langfristige Staatsanleihen mit „Investment Grade“ bewertet werden. Der Teilfonds kann bis zu 15% seines Nettovermögens in festverzinslichen Wertpapieren anlegen, die mit Ratings unterhalb von „Investment Grade“ bewertet werden, sofern diese Wertpapiere kein Rating unterhalb von B-/B3 aufweisen. Mindestens zwei Drittel des Nettovermögens des Teilfonds lauten auf Währungen der Länder der Europäischen Union und die Währung des Vereinigten Königreichs. Der Teilfonds kann bis zu ein Drittel seines Nettovermögens in Wertpapiere investieren, die auf Währungen anderer Länder lauten, deren langfristige Staatsanleihen mit „Investment Grade“ bewertet werden.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren mit „Investment Grade“-Rating anlegen möchten.

26. BlueBay Funds – BlueBay Impact-Aligned Bond Fund

Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin, durch Anlage in einem Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren mit „Investment Grade“-Rating, die die Kriterien von nachhaltigen Investitionen erfüllen, einen Gesamtertrag zu erzielen.

Der Teilfonds investiert mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens in fest- und variabel verzinsliche Wertpapiere mit „Investment Grade“-Rating. Der Teilfonds investiert mindestens 50% seines Nettovermögens in Unternehmensemittenten weltweit (einschließlich Emittenten aus Schwellenländern). Der Teilfonds kann bis zu ein Drittel seines Nettovermögens in festverzinslichen Wertpapieren anlegen, die mit Ratings unterhalb von „Investment Grade“ bewertet werden, sofern diese Wertpapiere kein Rating unterhalb von B-/B3 aufweisen. Der Teilfonds kann in auf USD und andere Währungen lautende Wertpapiere investieren, ausgenommen Wertpapiere, die auf Lokalwährungen von Schwellenländern lauten.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren mit „Investment Grade“-Rating anlegen möchten.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Zusammenfassung der Anlageziele der Teilfonds (Fortsetzung)

27. BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Government Bond Fund

Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin, durch Anlage in einem Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren mit „Investment Grade“-Rating und unter Berücksichtigung von ESG-Aspekten eine Gesamtertragsrendite zu erzielen, die über jener des Bloomberg Global Treasury Total Return Index USD hedged liegt. Es bestehen keine Einschränkungen, inwieweit das Portfolio und die Performance des Teilfonds von denen der Benchmark abweichen können. Der Anlageverwalter verfügt im Rahmen des Anlageprozesses über ein uneingeschränktes Ermessen hinsichtlich der Zusammensetzung des Portfolios des Teilfonds, und er kann ein Engagement in Unternehmen, Ländern oder Sektoren eingehen, die nicht in der Benchmark enthalten sind.

Der Teilfonds investiert mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens in fest- und variabel verzinsliche Wertpapiere mit „Investment Grade“-Rating, die von staatlichen Emittenten weltweit (einschließlich Emittenten aus Schwellenländern) begeben werden. Der Teilfonds kann bis zu 15% seines Nettovermögens in festverzinslichen Wertpapieren anlegen, die mit Ratings unterhalb von „Investment Grade“ bewertet werden, sofern diese Wertpapiere kein Rating unterhalb von B-/B3 aufweisen.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren anlegen möchten.

28. BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Financials Plus Bond Fund

Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin, durch Anlage in einem Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren mit „Investment Grade“-Rating und nachrangigen, von Finanzinstituten begebenen Schuldtiteln und unter Berücksichtigung von ESG-Aspekten einen Gesamtertrag zu erzielen.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert der Teilfonds mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens in fest- und variabel verzinsliche, vorrangige und nachrangige Schuldverschreibungen, die von Finanzinstituten mit „Investment Grade“-Rating begeben werden. Zu den nachrangigen Schuldtiteln gehören insbesondere Tier-1- und Tier-2-CoCo-Bonds und unbefristete US-Vorzugsaktien. Der Teilfonds kann insgesamt bis zu 10% seines Nettovermögens in festverzinslichen Wertpapieren mit Ratings unterhalb von „Investment Grade“ oder ohne Rating anlegen. Ein Wertpapier, das unterhalb von „Investment Grade“ eingestuft ist, darf kein Rating unter B3/B- besitzen.

Der Teilfonds ist für Anleger mit einem mittel- bis langfristigen Anlagehorizont (d. h. 3 bis 5 Jahre) geeignet, die in einem aktiv verwalteten Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren mit „Investment Grade“-Rating und nachrangigen Schuldtiteln anlegen möchten, die von Finanzinstituten begeben werden.

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
ANGOLA						
Angolanische internationale Staatsanleihe	8.25%	09/05/28	USD	4,015	3,713,875	0.60
Angolanische internationale Staatsanleihe	8.00%	26/11/29	USD	1,835	1,637,554	0.26
Angolanische internationale Staatsanleihe	8.75%	14/04/32	USD	4,050	3,589,313	0.58
					<u>8,940,742</u>	<u>1.44</u>
ARGENTINIEN						
Argentinische internationale Staatsanleihe, S/U	3.63%	09/07/35	USD	14,812	5,051,140	0.81
Argentinische internationale Staatsanleihe, S/U	3.50%	09/07/41	USD	12,596	4,302,981	0.69
					<u>9,354,121</u>	<u>1.50</u>
BAHRAIN						
Bahrainische internationale Staatsanleihe	6.00%	19/09/44	USD	3,125	2,583,125	0.41
KAIMANINSELN						
DP World Crescent Ltd	5.50%	13/09/33	USD	2,940	3,015,132	0.48
DP World Salaam, VRB	6.00%	31/12/49†	USD	5,545	5,544,279	0.89
EDO Sukuk Ltd	5.88%	21/09/33	USD	2,650	2,736,539	0.44
					<u>11,295,950</u>	<u>1.81</u>
CHILE						
Chilenische internationale Staatsanleihe	3.10%	07/05/41	USD	4,328	3,297,936	0.53
Chilenische internationale Staatsanleihe	4.00%	31/01/52	USD	3,700	3,050,766	0.49
Chilenische internationale Staatsanleihe	5.33%	05/01/54	USD	5,060	5,044,978	0.81
Corp. Nacional del Cobre de Chile	5.13%	02/02/33	USD	1,350	1,308,420	0.21
Corp. Nacional del Cobre de Chile	5.95%	08/01/34	USD	4,422	4,489,391	0.72
Corp. Nacional del Cobre de Chile	6.30%	08/09/53	USD	1,894	1,921,653	0.31
					<u>19,113,144</u>	<u>3.07</u>
KOLUMBIEN						
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	3.25%	22/04/32	USD	5,565	4,440,696	0.71
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	8.00%	20/04/33	USD	5,875	6,434,043	1.03
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	8.75%	14/11/53	USD	3,980	4,583,841	0.74
Ecopetrol SA	8.88%	13/01/33	USD	2,635	2,865,562	0.46
Ecopetrol SA	5.88%	02/11/51	USD	4,043	3,075,207	0.50
					<u>21,399,349</u>	<u>3.44</u>
COSTA RICA						
Costa-ricanische internationale Staatsanleihe	6.55%	03/04/34	USD	2,710	2,816,368	0.45
Costa-ricanische internationale Staatsanleihe	7.30%	13/11/54	USD	3,340	3,633,953	0.59
					<u>6,450,321</u>	<u>1.04</u>

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
DOMINIKANISCHE REPUBLIK						
Dominikanische internationale Staatsanleihe	5.50%	27/01/25	USD	6,000	5,980,350	0.96
Dominikanische internationale Staatsanleihe	6.88%	29/01/26	USD	2,700	2,754,567	0.44
Dominikanische internationale Staatsanleihe	5.95%	25/01/27	USD	5,155	5,183,765	0.83
Dominikanische internationale Staatsanleihe	6.00%	19/07/28	USD	2,125	2,133,500	0.35
Dominikanische internationale Staatsanleihe	7.05%	03/02/31	USD	3,200	3,368,336	0.54
					19,420,518	3.12
ECUADOR						
Ecuadorianische internationale Staatsanleihe, S/U	3.50%	31/07/35	USD	9,522	3,423,003	0.55
ÄGYPTEN						
Ägyptische internationale Staatsanleihe	5.25%	06/10/25	USD	1,010	926,675	0.15
Ägyptische internationale Staatsanleihe	6.59%	21/02/28	USD	2,873	2,212,659	0.36
Ägyptische internationale Staatsanleihe	5.88%	16/02/31	USD	1,121	737,583	0.12
Ägyptische internationale Staatsanleihe	7.05%	15/01/32	USD	921	633,763	0.10
Ägyptische internationale Staatsanleihe	7.30%	30/09/33	USD	733	486,529	0.08
Ägyptische internationale Staatsanleihe	7.90%	21/02/48	USD	10,283	6,230,855	1.00
Ägyptische internationale Staatsanleihe	8.70%	01/03/49	USD	1,900	1,195,813	0.19
Ägyptische internationale Staatsanleihe	7.50%	16/02/61	USD	6,485	3,805,884	0.61
					16,229,761	2.61
EL SALVADOR						
Internationale Staatsanleihe El Salvador	7.65%	15/06/35	USD	1,792	1,403,920	0.23
Internationale Staatsanleihe El Salvador	7.63%	01/02/41	USD	1,864	1,402,660	0.22
					2,806,580	0.45
GUATEMALA						
Guatemaltekkische Staatsanleihe	6.60%	13/06/36	USD	3,040	3,138,800	0.50
UNGARN						
Ungarische internationale Staatsanleihe	3.13%	21/09/51	USD	6,430	4,378,316	0.70
INDONESIEN						
Indonesische internationale Staatsanleihe	3.35%	12/03/71	USD	7,200	5,295,375	0.85
IRAK						
Irakische internationale Staatsanleihe	5.80%	15/01/28	USD	3,547	3,328,201	0.53

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
JERSEY						
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd	2.94%	30/09/40	USD	7,018	5,811,778	0.93
JORDANIEN						
Jordanische internationale Staatsanleihe	7.38%	10/10/47	USD	3,260	2,906,290	0.47
KENIA						
Kenianische internationale Staatsanleihe	6.88%	24/06/24	USD	1,906	1,858,052	0.30
LIBANON						
Libanesische internationale Staatsanleihe †	6.38%	09/03/20 ^β	USD	12,821	801,313	0.13
Libanesische internationale Staatsanleihe †	5.80%	14/04/20 ^β	USD	1,268	79,250	0.01
Libanesische internationale Staatsanleihe †	6.15%	19/06/20 ^β	USD	3,762	235,125	0.04
Libanesische internationale Staatsanleihe †	8.25%	12/04/21 ^β	USD	3,396	211,189	0.03
Libanesische internationale Staatsanleihe †	6.10%	04/10/22 ^β	USD	2,316	144,388	0.02
Libanesische internationale Staatsanleihe †	6.00%	27/01/23 ^β	USD	2,197	135,596	0.02
Libanesische internationale Staatsanleihe †	8.25%	17/05/34	USD	694	43,375	0.01
					1,650,236	0.26
LUXEMBURG						
Greensaif Pipelines Bidco Sarl	6.13%	23/02/38	USD	3,300	3,454,687	0.55
Greensaif Pipelines Bidco Sarl	6.51%	23/02/42	USD	2,635	2,781,984	0.45
					6,236,671	1.00
MEXIKO						
Comision Federal de Electricidad	4.69%	15/05/29	USD	3,805	3,593,347	0.58
Mexico City Airport Trust	5.50%	31/07/47	USD	4,303	3,722,870	0.60
Mexikanische internationale Staatsanleihe	5.40%	09/02/28	USD	2,640	2,709,712	0.43
Mexikanische internationale Staatsanleihe	6.34%	04/05/53	USD	1,960	2,002,569	0.32
Mexikanische internationale Staatsanleihe	3.77%	24/05/61	USD	14,120	9,606,012	1.54
					21,634,510	3.47
MAROKKO						
Marokkanische internationale Staatsanleihe	5.95%	08/03/28	USD	2,120	2,179,625	0.35
NIEDERLANDE						
MV24 Capital BV	6.75%	01/06/34	USD	3,912	3,659,870	0.59
NIGERIA						
Nigerianische internationale Staatsanleihe	6.13%	28/09/28	USD	4,960	4,412,850	0.71
Nigerianische internationale Staatsanleihe	7.88%	16/02/32	USD	2,536	2,286,759	0.37
Nigerianische internationale Staatsanleihe	7.38%	28/09/33	USD	1,105	945,811	0.15

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
NIGERIA (Fortsetzung)						
Nigerianische internationale Staatsanleihe	7.63%	28/11/47	USD	3,210	2,556,139	0.41
					10,201,559	1.64
NORDMAZEDONIEN						
Nordmazedonische internationale Staatsanleihe	6.96%	13/03/27	EUR	2,425	2,802,991	0.45
OMAN						
Omanische internationale Staatsanleihe	4.88%	01/02/25	USD	7,593	7,545,544	1.21
Omanische internationale Staatsanleihe	6.75%	28/10/27	USD	7,950	8,412,094	1.35
Omanische internationale Staatsanleihe	6.75%	17/01/48	USD	14,820	15,544,791	2.50
Omanische internationale Staatsanleihe	7.00%	25/01/51	USD	4,080	4,413,412	0.71
OQ SAOC	5.13%	06/05/28	USD	4,840	4,798,406	0.77
					40,714,247	6.54
PAKISTAN						
Pakistanische internationale Staatsanleihe	8.25%	30/09/25	USD	1,316	1,124,563	0.18
Pakistanische internationale Staatsanleihe	6.00%	08/04/26	USD	3,026	2,152,715	0.35
Pakistanische internationale Staatsanleihe	7.38%	08/04/31	USD	6,591	4,048,316	0.65
Pakistanische internationale Staatsanleihe	7.88%	31/03/36	USD	595	378,569	0.06
					7,704,163	1.24
PARAGUAY						
Paraguayische internationale Staatsanleihe	5.40%	30/03/50	USD	4,856	4,347,334	0.70
PHILIPPINEN						
ROP Sukuk Trust	5.05%	06/06/29	USD	1,830	1,864,884	0.30
POLEN						
Bank Gospodarstwa Krajowego	5.38%	22/05/33	USD	2,725	2,769,145	0.45
Polnische internationale Staatsanleihe	5.75%	16/11/32	USD	2,665	2,885,569	0.46
Polnische internationale Staatsanleihe	5.50%	04/04/53	USD	3,020	3,160,098	0.51
					8,814,812	1.42
KATAR						
Katarische internationale Staatsanleihe	5.10%	23/04/48	USD	600	608,841	0.10
Katarische internationale Staatsanleihe	4.82%	14/03/49	USD	2,863	2,794,073	0.45
Katarische internationale Staatsanleihe	4.40%	16/04/50	USD	4,362	4,042,178	0.65
QatarEnergy	3.13%	12/07/41	USD	2,640	2,036,813	0.32

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
KATAR (Fortsetzung)						
QatarEnergy	3.30%	12/07/51	USD	3,217	2,357,305	0.38
					11,839,210	1.90
RUMÄNIEN						
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.00%	14/04/33	EUR	1,433	1,183,265	0.19
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.63%	02/12/40	EUR	4,124	3,074,627	0.50
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.75%	14/04/41	EUR	10,634	7,908,741	1.27
Rumänische internationale Staatsanleihe	3.38%	28/01/50	EUR	3,659	2,762,871	0.44
					14,929,504	2.40
SERBIEN						
Serbische internationale Anleihe	6.25%	26/05/28	USD	2,612	2,680,173	0.43
Serbische internationale Anleihe	6.50%	26/09/33	USD	1,025	1,052,972	0.17
Serbische internationale Anleihe	2.05%	23/09/36	EUR	4,215	3,255,010	0.52
					6,988,155	1.12
SÜDAFRIKA						
Eskom Holdings SOC Ltd	7.13%	11/02/25	USD	1,853	1,856,764	0.30
Südafrikanische internationale Staatsanleihe	4.85%	30/09/29	USD	5,835	5,489,458	0.88
Südafrikanische internationale Staatsanleihe	5.38%	24/07/44	USD	7,466	5,976,300	0.96
Südafrikanische internationale Staatsanleihe	5.00%	12/10/46	USD	5,449	4,042,477	0.65
Südafrikanische internationale Staatsanleihe	7.30%	20/04/52	USD	435	412,978	0.06
					17,777,977	2.85
SRI LANKA						
Sri-lankische internationale Staatsanleihe, FTB *	5.75%	18/04/23 ^ß	USD	455	234,580	0.04
Sri-lankische internationale Staatsanleihe, FTB *	6.85%	14/03/24	USD	2,803	1,427,778	0.23
Sri-lankische internationale Staatsanleihe, FTB *	6.35%	28/06/24	USD	348	177,371	0.03
Sri-lankische internationale Staatsanleihe, FTB *	6.83%	18/07/26	USD	1,796	924,940	0.15
Sri-lankische internationale Staatsanleihe, FTB *	6.20%	11/05/27	USD	3,315	1,681,327	0.27
Sri-lankische internationale Staatsanleihe, FTB *	6.75%	18/04/28	USD	1,333	676,289	0.11
Sri-lankische internationale Staatsanleihe, FTB *	7.85%	14/03/29	USD	1,665	843,166	0.13
					5,965,451	0.96
TUNESIEN						
Tunesische Republik	5.63%	17/02/24	EUR	5,070	5,429,254	0.87
Tunesische Republik	5.75%	30/01/25	USD	2,450	2,014,359	0.33
					7,443,613	1.20
TÜRKEI						
Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS	8.51%	14/01/29	USD	3,290	3,497,270	0.56

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
TÜRKEI (Fortsetzung)						
Istanbul Metropolitan Municipality	10.75%	12/04/27	USD	1,810	1,917,523	0.31
Istanbul Metropolitan Municipality	10.50%	06/12/28	USD	2,100	2,236,710	0.36
Türkische internationale Staatsanleihe	4.88%	16/04/43	USD	15,695	11,507,182	1.85
Türkische internationale Staatsanleihe	5.75%	11/05/47	USD	9,760	7,649,400	1.23
Türkiye Ihracat Kredi Bankasi AS	9.00%	28/01/27	USD	1,050	1,096,101	0.17
Ziraat Katilim Varlik Kiralama AS	9.38%	12/11/26	USD	2,150	2,268,586	0.36
					<u>30,172,772</u>	<u>4.84</u>
UKRAINE						
Ukrainische internationale Staatsanleihe, FTB *	7.75%	01/09/28	USD	3,732	1,053,357	0.17
Ukrainische internationale Staatsanleihe, FTB *	7.38%	25/09/34	USD	17,531	4,185,526	0.67
Ukrainische internationale Staatsanleihe, FRB [‡]	7.75%	01/08/41	USD	10,539	4,745,607	0.76
					<u>9,984,490</u>	<u>1.60</u>
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE						
Abu Dhabi internationale Staatsanleihe	3.13%	30/09/49	USD	5,530	4,077,463	0.65
Abu Dhabi internationale Staatsanleihe	2.70%	02/09/70	USD	4,499	2,861,251	0.46
Finanzministerium Sharjah	4.00%	28/07/50	USD	8,973	6,011,910	0.97
MDGH GMTN RSC Ltd	5.50%	28/04/33	USD	1,820	1,933,131	0.31
MDGH GMTN RSC Ltd	4.38%	22/11/33	USD	1,800	1,756,197	0.28
					<u>16,639,952</u>	<u>2.67</u>
VEREINIGTE STAATEN						
Schatzanweisung der Vereinigten Staaten	2.75%	15/02/24	USD	40,275	40,148,250	6.45
Schatzanweisung der Vereinigten Staaten	3.00%	30/06/24	USD	25,875	25,604,738	4.11
					<u>65,752,988</u>	<u>10.56</u>
USBEKISTAN						
Usbekische internationale Staatsanleihe	7.85%	12/10/28	USD	4,190	4,387,715	0.70
Usbekische internationale Staatsanleihe	3.90%	19/10/31	USD	3,285	2,764,533	0.44
Uzbekneftegaz JSC	4.75%	16/11/28	USD	3,548	2,960,917	0.48
					<u>10,113,165</u>	<u>1.62</u>
VENEZUELA						
Petroleos de Venezuela SA *	8.50%	27/10/20 ^β	USD	12,676	10,088,906	1.62
Venezolanische internationale Staatsanleihe *	7.75%	13/10/19 ^β	USD	3,970	551,458	0.09
Venezolanische internationale Staatsanleihe *	8.25%	13/10/24	USD	3,927	589,050	0.09
Venezolanische internationale Staatsanleihe *	11.75%	21/10/26	USD	8,585	1,616,394	0.26
					<u>12,845,808</u>	<u>2.06</u>

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
SAMBIA						
Sambische internationale Staatsanleihe, FTB *	5.38%	20/09/22 ^β	USD	6,071	3,413,784	0.55
ANLEIHEN INSGESAMT					473,411,197	76.01
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt					473,411,197	76.01
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
BRASILIEN						
Brasilianische internationale Staatsanleihe	6.25%	18/03/31	USD	4,400	4,573,690	0.73
KAIMANINSELN						
Rutas 2 & 7 Finance Ltd	0.00%	30/09/36	USD	3,267	2,156,950	0.35
CHILE						
Empresa de los Ferrocarriles del Estado	3.83%	14/09/61	USD	5,230	3,593,716	0.58
KOLUMBIEN						
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	7.50%	02/02/34	USD	3,330	3,520,434	0.57
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	8.00%	14/11/35	USD	5,350	5,862,430	0.94
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	5.00%	15/06/45	USD	6,325	4,913,734	0.79
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	4.13%	15/05/51	USD	3,480	2,323,987	0.37
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	3.88%	15/02/61	USD	7,685	4,810,330	0.77
Ecopetrol SA	8.63%	19/01/29	USD	2,870	3,069,555	0.49
Ecopetrol SA	5.88%	28/05/45	USD	642	506,538	0.08
					25,007,008	4.01
EL SALVADOR						
Internationale Staatsanleihe El Salvador	6.38%	18/01/27	USD	3,700	3,272,187	0.53
GUATEMALA						
Guatemaltekkische Staatsanleihe	3.70%	07/10/33	USD	3,865	3,231,140	0.52
JERSEY						
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd	2.16%	31/03/34	USD	3,106	2,704,257	0.43
MEXIKO						
Petroleos Mexicanos	5.63%	23/01/46	USD	19,481	11,868,799	1.91
Petroleos Mexicanos	6.35%	12/02/48	USD	8,741	5,566,182	0.89
					17,434,981	2.80
PANAMA						
Panamaische internationale Staatsanleihe	4.50%	01/04/56	USD	11,998	8,093,026	1.30

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
PANAMA (Fortsetzung)						
Panamaische internationale Staatsanleihe	3.87%	23/07/60	USD	8,109	4,874,269	0.78
					12,967,295	2.08
PARAGUAY						
Paraguayische internationale Staatsanleihe	5.85%	21/08/33	USD	3,510	3,586,343	0.58
PERU						
InRetail Consumer	3.25%	22/03/28	USD	6,209	5,554,145	0.89
PHILIPPINEN						
Philippinische internationale Staatsanleihe	5.61%	13/04/33	USD	3,106	3,326,817	0.53
Philippinische internationale Staatsanleihe	5.00%	17/07/33	USD	2,460	2,534,569	0.41
Philippinische internationale Staatsanleihe	2.95%	05/05/45	USD	6,317	4,759,465	0.76
					10,620,851	1.70
RUMÄNIEN						
Rumänische internationale Staatsanleihe	3.38%	08/02/38	EUR	3,433	2,975,808	0.48
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE						
MDGH GMTN RSC Ltd	5.08%	22/05/53	USD	1,080	1,062,293	0.17
URUGUAY						
Uruguayische internationale Staatsanleihe	4.98%	20/04/55	USD	6,246	6,115,161	0.98
VENEZUELA						
Petroleos de Venezuela SA †	6.00%	15/11/26	USD	7,405	844,616	0.14
ANLEIHEN INSGESAMT					105,700,441	16.97
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt					105,700,441	16.97

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Anlagen insgesamt <i>(Kosten USD 665,842,401)</i>	579,111,638	92.98
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten	43,681,429	7.02
Nettovermögen insgesamt	622,793,067	100.00

Glossar:

FTB - Flat Trading Bond (pauschal gehandelte Anleihe)

FRB - Floating Rate Bond (Anleihe mit variablem Zins)

S/U - Step Up Bond

VRB - Variable Rate Bond (variabel verzinsliche Anleihe)

± notleidendes Wertpapier

† Unbefristete Laufzeit

β Die Anlage stellt ein offenstehendes Geschäft nach dem Fälligkeitsdatum dar

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.

Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay High Yield ESG Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
ÖSTERREICH						
Benteler International AG	9.38%	15/05/28	EUR	1,958	2,098,654	0.66
DÄNEMARK						
Orsted AS, VRB	1.75%	09/12/19 [^]	EUR	1,308	1,149,796	0.36
TDC Net	5.62%	06/02/30	EUR	656	678,139	0.22
TDC Net A/S	6.50%	01/06/31	EUR	487	516,187	0.16
					2,344,122	0.74
FINNLAND						
Balder Finland OYJ	1.00%	18/01/27	EUR	699	593,162	0.19
Balder Finland OYJ	1.00%	20/01/29	EUR	1,000	764,251	0.24
PHM Group Holding Oy 144A	4.75%	18/06/26	EUR	207	189,405	0.06
SBB Treasury OYJ	1.13%	26/11/29	EUR	2,268	1,345,552	0.43
SBB Treasury OYJ, FRB	4.51%	08/02/24	EUR	560	555,061	0.17
					3,447,431	1.09
FRANKREICH						
Accor SA, VRB	7.25%	31/12/49 [†]	EUR	700	763,328	0.24
Altice France SA/France	5.88%	01/02/27	EUR	651	582,557	0.18
Altice France SA/France	3.38%	15/01/28	EUR	551	438,805	0.14
Altice France SA/France	4.25%	15/10/29	EUR	3,471	2,772,333	0.88
Atos SE	1.75%	07/05/25	EUR	200	153,973	0.05
Atos SE	1.00%	12/11/29	EUR	200	108,928	0.03
Banijay Entertainment SASU	7.00%	01/05/29	EUR	1,470	1,554,587	0.49
Banijay Group SAS	6.50%	01/03/26	EUR	1,117	1,118,726	0.35
BNP Paribas SA 144A, VRB	7.75%	31/12/49 [†]	USD	1,364	1,263,514	0.40
CAB SELAS	3.38%	01/02/28	EUR	3,213	2,871,937	0.91
Cerba Healthcare SACA	3.50%	31/05/28	EUR	834	700,601	0.22
Emeria SASU	3.38%	31/03/28	EUR	2,599	2,239,168	0.71
Forvia SE	7.25%	15/06/26	EUR	1,120	1,190,078	0.38
Forvia SE	2.75%	15/02/27	EUR	1,007	966,454	0.31
Forvia SE	2.38%	15/06/27	EUR	1,388	1,316,064	0.42
Forvia SE	3.75%	15/06/28	EUR	430	422,469	0.13
Iliad Holding SASU	5.13%	15/10/26	EUR	910	909,922	0.29
Iliad Holding SASU	5.63%	15/10/28	EUR	2,788	2,806,654	0.89
iliad SA	1.88%	11/02/28	EUR	1,000	919,619	0.29
Loxam SAS	4.50%	15/02/27	EUR	1,336	1,337,897	0.42
Parts Europe SA, FRB	7.99%	20/07/27	EUR	2,526	2,550,788	0.81
Veolia Environnement SA, VRB	2.50%	31/12/49 [†]	EUR	800	718,054	0.23
					27,706,456	8.77
DEUTSCHLAND						
BRANICKS Group AG	2.25%	22/09/26	EUR	1,600	549,454	0.17
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	4.38%	15/01/28	EUR	906	885,701	0.28
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	7.50%	15/05/30	EUR	809	863,941	0.27
Commerzbank AG, VRB	6.75%	05/10/33	EUR	700	746,900	0.24
Commerzbank AG, VRB	6.13%	31/12/49 [†]	EUR	3,000	2,904,927	0.92
DEMIRE Deutsche Mittelstand Real Estate AG	1.88%	15/10/24	EUR	1,400	861,001	0.27
Deutsche Bank AG, VRB	10.00%	31/12/49 [†]	EUR	1,400	1,531,225	0.48
Deutsche Bank AG, VRB	5.63%	19/05/31	EUR	1,900	1,927,087	0.61
Gruenthal GmbH	3.63%	15/11/26	EUR	805	796,547	0.25
Gruenthal GmbH	6.75%	15/05/30	EUR	2,127	2,261,799	0.72
IHO Verwaltungs GmbH, PIK	3.75%	15/09/26	EUR	743	734,785	0.23
IHO Verwaltungs GmbH, PIK	8.75%	15/05/28	EUR	1,820	1,987,149	0.63
Nidda Healthcare Holding GmbH	7.50%	21/08/26	EUR	4,269	4,407,683	1.40
Novelis Sheet Ingot GmbH	3.38%	15/04/29	EUR	1,587	1,502,261	0.48
Peach Property Finance GmbH	4.38%	15/11/25	EUR	1,233	976,087	0.31
Schaeffler AG	1.88%	26/03/24	EUR	3,000	2,984,577	0.95

BlueBay Funds – BlueBay High Yield ESG Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
DEUTSCHLAND (Fortsetzung)						
Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH	2.00%	15/07/25	EUR	2,862	2,806,740	0.89
Tele Columbus AG, FTB †	3.88%	02/05/25	EUR	1,694	1,095,171	0.35
TUI Cruises GmbH	6.50%	15/05/26	EUR	1,524	1,508,781	0.48
ZF Finance GmbH	3.00%	21/09/25	EUR	1,400	1,370,978	0.43
ZF Finance GmbH	2.00%	06/05/27	EUR	1,100	1,019,688	0.32
ZF Finance GmbH	2.25%	03/05/28	EUR	700	644,330	0.20
ZF Finance GmbH	3.75%	21/09/28	EUR	500	483,716	0.15
					34,850,528	11.03
IRLAND						
Bank of Cyprus Holdings Plc, VRB	6.63%	23/10/31	EUR	1,126	1,106,115	0.35
ITALIEN						
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	10.50%	23/07/29	EUR	770	847,551	0.27
Cedacri Mergerco SPA, FRB	9.50%	15/05/28	EUR	1,060	1,049,400	0.33
Engineering Ingegneria Informatica SpA	11.13%	15/05/28	EUR	1,384	1,484,597	0.47
Fiber Bidco SpA	11.00%	25/10/27	EUR	913	999,735	0.32
Fiber Bidco SpA, FRB	9.89%	25/10/27	EUR	572	582,581	0.18
Golden Goose SpA, FRB	8.88%	14/05/27	EUR	1,354	1,366,355	0.43
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	9.13%	31/12/49†	EUR	970	1,069,699	0.34
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	4.13%	31/12/49†	EUR	1,892	1,522,755	0.48
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	5.88%	31/12/49†	EUR	1,915	1,732,158	0.55
Italmatch Chemicals SpA	10.00%	06/02/28	EUR	889	921,164	0.29
Italmatch Chemicals SpA, FRB	9.39%	06/02/28	EUR	466	465,476	0.15
Marcolin SpA	6.13%	15/11/26	EUR	696	667,688	0.21
Rekeep SpA	7.25%	01/02/26	EUR	439	395,948	0.13
Shiba Bidco SpA	4.50%	31/10/28	EUR	1,560	1,470,542	0.47
Telecom Italia SpA/Milano	2.75%	15/04/25	EUR	1,037	1,012,687	0.32
Telecom Italia SpA/Milano	2.38%	12/10/27	EUR	208	194,958	0.06
Telecom Italia SpA/Milano	6.88%	15/02/28	EUR	848	905,276	0.29
Telecom Italia SpA/Milano	7.88%	31/07/28	EUR	3,098	3,450,243	1.09
UniCredit SpA, VRB	4.45%	31/12/49†	EUR	1,500	1,337,992	0.42
UniCredit SpA, VRB	7.50%	31/12/49†	EUR	1,670	1,722,822	0.55
					23,199,627	7.35
JAPAN						
Rakuten Group Inc, VRB	4.25%	31/12/49†	EUR	1,231	835,844	0.26
JERSEY						
AA Bond Co Ltd	6.50%	31/01/26	GBP	706	778,082	0.25
AA Bond Co Ltd	8.45%	31/01/28	GBP	759	919,854	0.29
AA Bond Co Ltd	7.38%	31/07/29	GBP	1,132	1,308,752	0.42
Adient Global Holdings Ltd	3.50%	15/08/24	EUR	831	824,839	0.26
Avis Budget Finance Plc	7.25%	31/07/30	EUR	3,009	3,229,999	1.02
Galaxy Bidco Ltd	6.50%	31/07/26	GBP	1,281	1,434,703	0.45
Heathrow Funding Ltd	7.13%	14/02/24	GBP	1,542	1,781,480	0.57
					10,277,709	3.26
LUXEMBURG						
Altice Financing SA	2.25%	15/01/25	EUR	1,019	992,313	0.31
Altice Financing SA	3.00%	15/01/28	EUR	2,388	2,139,648	0.68
Altice Financing SA	4.25%	15/08/29	EUR	744	662,346	0.21
B&M European Value Retail SA	8.13%	15/11/30	GBP	498	612,427	0.19
Cidron Aida Finco Sarl	5.00%	01/04/28	EUR	993	958,983	0.30
Consolidated Energy Finance SA	5.00%	15/10/28	EUR	2,209	1,804,090	0.57
Cullinan Holdco Scsp	4.63%	15/10/26	EUR	1,939	1,515,716	0.48
Dana Financing Luxembourg Sarl	3.00%	15/07/29	EUR	711	630,101	0.20

BlueBay Funds – BlueBay High Yield ESG Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
LUXEMBURG (Fortsetzung)						
Dana Financing Luxembourg Sarl	8.50%	15/07/31	EUR	1,464	1,606,381	0.51
Lune Holdings Sarl	5.63%	15/11/28	EUR	2,288	1,874,305	0.59
Matterhorn Telecom SA	2.63%	15/09/24	EUR	1,541	1,525,128	0.48
Matterhorn Telecom SA	3.13%	15/09/26	EUR	1,372	1,331,693	0.42
Matterhorn Telecom SA	4.00%	15/11/27	EUR	949	937,159	0.30
Paper Industries Intermediate Financing Sarl, FRB	10.46%	01/09/28	EUR	1,691	1,155,274	0.37
PLT VII Finance Sarl, FRB	8.59%	05/01/26	EUR	1,000	1,006,465	0.32
Rossini Sarl, FRB	7.83%	30/10/25	EUR	1,567	1,574,835	0.50
Samsonite Finco Sarl	3.50%	15/05/26	EUR	754	744,176	0.24
Signa Development Finance SCS *	5.50%	23/07/26	EUR	1,500	132,750	0.04
					21,203,790	6.71
MULTINATIONAL						
Clarios Global LP / Clarios US Finance Co	4.38%	15/05/26	EUR	2,876	2,861,516	0.91
NIEDERLANDE						
Abertis Infraestructuras Finance BV, VRB	2.63%	31/12/49†	EUR	4,500	4,109,562	1.30
Cooperatieve Rabobank UA, VRB	4.88%	31/12/49†	EUR	2,200	1,991,935	0.63
GTCR W-2 Merger Sub LLC / GTCR W Dutch Finance Sub BV	8.50%	15/01/31	GBP	2,395	2,996,762	0.95
Heimstaden Bostad Treasury BV	1.63%	13/10/31	EUR	1,800	1,142,176	0.36
Koninklijke KPN NV, VRB	6.00%	31/12/49†	EUR	700	726,845	0.23
PPF Telecom Group BV	3.13%	27/03/26	EUR	1,094	1,075,580	0.34
Q-Park Holding I BV	1.50%	01/03/25	EUR	3,470	3,408,269	1.08
Telefonica Europe BV, VRB	2.38%	31/12/49†	EUR	2,800	2,439,427	0.77
Telefonica Europe BV, VRB	6.75%	31/12/49†	EUR	1,900	2,033,450	0.65
Telefonica Europe BV, VRB	3.88%	31/12/49†	EUR	2,800	2,716,616	0.86
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	1.63%	15/10/28	EUR	1,000	855,036	0.27
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	7.38%	15/09/29	EUR	1,880	2,062,343	0.65
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	4.38%	09/05/30	EUR	2,582	2,430,992	0.77
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	7.88%	15/09/31	EUR	1,590	1,806,437	0.57
United Group BV	4.00%	15/11/27	EUR	608	577,331	0.18
United Group BV	3.63%	15/02/28	EUR	500	464,873	0.15
United Group BV	5.25%	01/02/30	EUR	2,354	2,237,548	0.71
United Group BV, FRB	7.25%	15/02/26	EUR	778	779,025	0.25
UPC Holding BV	3.88%	15/06/29	EUR	1,950	1,814,003	0.58
Versuni Group BV	3.13%	15/06/28	EUR	906	799,481	0.25
ZF Europe Finance BV	6.13%	13/03/29	EUR	600	639,321	0.20
Ziggo Bond Co BV	3.38%	28/02/30	EUR	982	832,397	0.26
					37,939,409	12.01
PORTUGAL						
Transportes Aereos Portugueses SA	5.63%	02/12/24	EUR	800	795,030	0.25
SPANIEN						
Aedas Homes Opco SLU	4.00%	15/08/26	EUR	1,607	1,521,885	0.48
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, VRB	8.38%	31/12/49†	EUR	1,400	1,520,750	0.48
Banco de Sabadell SA, VRB	5.00%	31/12/49†	EUR	2,000	1,726,450	0.55
Banco de Sabadell SA, VRB	9.38%	31/12/49†	EUR	400	428,836	0.14
Banco de Sabadell SA, VRB	2.00%	17/01/30	EUR	800	772,570	0.24
Banco Santander SA, VRB	3.63%	31/12/49†	EUR	1,000	749,809	0.24
Banco Santander SA, VRB	7.50%	31/12/49†	USD	3,000	2,717,452	0.86

BlueBay Funds – BlueBay High Yield ESG Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
SPANIEN (Fortsetzung)						
CaixaBank SA, VRB	5.88%	31/12/49†	EUR	1,000	971,375	0.31
Cellnex Finance Co SA	2.25%	12/04/26	EUR	4,700	4,569,373	1.45
Cellnex Finance Co SA	2.00%	15/09/32	EUR	900	771,931	0.24
Cellnex Telecom SA	0.75%	20/11/31	EUR	800	668,270	0.21
Eroski S Coop	10.63%	30/04/29	EUR	2,265	2,339,312	0.74
Grifols SA	3.88%	15/10/28	EUR	2,393	2,192,493	0.69
Ibercaja Banco SA, VRB	2.75%	23/07/30	EUR	1,000	959,395	0.30
International Consolidated Airlines Group SA	3.75%	25/03/29	EUR	800	777,856	0.25
Kaixo Bondco Telecom SA	5.13%	30/09/29	EUR	3,677	3,456,380	1.09
Lorca Telecom Bondco SA	4.00%	18/09/27	EUR	2,071	2,026,981	0.64
NH Hotel Group SA	4.00%	02/07/26	EUR	1,514	1,501,570	0.48
					29,672,688	9.39
SCHWEDEN						
Fastighets AB Balder	1.25%	28/01/28	EUR	320	261,529	0.08
Heimstaden Bostad AB, VRB	3.63%	31/12/49†	EUR	1,400	550,077	0.17
Intrum AB	3.00%	15/09/27	EUR	1,074	822,153	0.26
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB	2.25%	12/08/27	EUR	592	399,125	0.13
Verisure Holding AB	3.88%	15/07/26	EUR	2,584	2,543,444	0.81
Verisure Holding AB	3.25%	15/02/27	EUR	918	883,818	0.28
Verisure Holding AB	9.25%	15/10/27	EUR	1,192	1,283,846	0.41
					6,743,992	2.14
SCHWEIZ						
UBS Group AG, VRB	3.25%	02/04/26	EUR	240	237,935	0.07
UBS Group AG, VRB	7.75%	01/03/29	EUR	1,275	1,471,112	0.47
					1,709,047	0.54
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Agps Bondco Plc, FTB *	4.63%	14/01/26	EUR	2,700	955,125	0.30
Barclays Plc, VRB	8.00%	31/12/49†	USD	830	739,281	0.23
Barclays Plc, VRB	8.41%	14/11/32	GBP	1,020	1,256,875	0.40
Barclays Plc, VRB	6.38%	31/12/49†	GBP	725	798,171	0.25
BCP V Modular Services Finance Plc	6.75%	30/11/29	EUR	1,263	1,042,158	0.33
Bellis Acquisition Co. Plc	3.25%	16/02/26	GBP	2,551	2,739,199	0.87
Bellis Acquisition Co. Plc	4.50%	16/02/26	GBP	225	246,452	0.08
Bellis Finco Plc	4.00%	16/02/27	GBP	1,530	1,541,530	0.49
Co-operative Group Holdings 2011 Ltd, S/U	7.50%	08/07/26	GBP	1,138	1,298,834	0.41
Gatwick Airport Finance Plc	4.38%	07/04/26	GBP	819	908,526	0.29
Heathrow Finance Plc	4.75%	01/03/24	GBP	2,454	2,825,220	0.90
Heathrow Finance Plc, S/U	3.88%	01/03/27	GBP	1,253	1,336,300	0.42
Heathrow Finance Plc, S/U	4.13%	01/09/29	GBP	1,977	1,979,215	0.63
HSBC Holdings Plc, VRB	8.20%	16/11/34	GBP	1,220	1,556,116	0.49
Iceland Bondco Plc	10.88%	15/12/27	GBP	874	1,055,204	0.33
Iceland Bondco Plc	4.38%	15/05/28	GBP	917	887,604	0.28
Jaguar Land Rover Automotive Plc	4.50%	15/07/28	EUR	2,199	2,154,085	0.68
Jerrold Finco Plc	4.88%	15/01/26	GBP	3,404	3,803,706	1.20
Jerrold Finco Plc	5.25%	15/01/27	GBP	727	784,587	0.25
Lloyds Bank Corporate Markets Plc	4.13%	30/05/27	EUR	1,100	1,126,885	0.36
Market Bidco Finco Plc	5.50%	04/11/27	GBP	1,919	1,957,139	0.62
NGG Finance Plc, VRB	2.13%	05/09/82	EUR	3,334	3,035,674	0.96
Ocado Group Plc	3.88%	08/10/26	GBP	1,007	1,002,313	0.32
PEU Finance Plc	7.25%	01/07/28	EUR	2,308	2,381,507	0.75
Pinewood Finance Co Ltd	3.25%	30/09/25	GBP	2,476	2,785,151	0.88
Pinnacle Bidco Plc	10.00%	11/10/28	GBP	2,796	3,362,771	1.07
RAC Bond Co. Plc	8.25%	06/11/28	GBP	941	1,170,845	0.37
Thames Water Kemble Finance Plc	4.63%	19/05/26	GBP	600	353,906	0.11

BlueBay Funds – BlueBay High Yield ESG Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)						
TI Automotive Finance Plc	3.75%	15/04/29	EUR	1,672	1,537,329	0.49
Vmed O2 UK Financing I Plc	3.25%	31/01/31	EUR	1,510	1,392,960	0.44
Vmed O2 UK Financing I Plc	4.50%	15/07/31	GBP	2,954	2,957,265	0.94
Vodafone Group Plc, VRB	2.63%	27/08/80	EUR	1,469	1,399,728	0.44
Vodafone Group Plc, VRB	3.00%	27/08/80	EUR	2,418	2,169,928	0.69
Vodafone Group Plc, VRB	8.00%	30/08/86	GBP	1,581	1,953,188	0.62
					56,494,777	17.89
VEREINIGTE STAATEN						
Belden Inc	3.88%	15/03/28	EUR	700	681,318	0.22
Belden Inc	3.38%	15/07/31	EUR	1,915	1,694,015	0.54
Berry Global Inc	1.00%	15/01/25	EUR	1,000	972,153	0.31
Encore Capital Group Inc	5.38%	15/02/26	GBP	1,301	1,436,954	0.45
Netflix Inc	3.88%	15/11/29	EUR	679	703,558	0.22
Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV	2.88%	30/04/28	EUR	3,512	3,234,879	1.02
Primo Water Holdings Inc	3.88%	31/10/28	EUR	938	907,614	0.29
Standard Industries Inc/NJ	2.25%	21/11/26	EUR	1,391	1,319,654	0.42
UGI International LLC	2.50%	01/12/29	EUR	1,629	1,391,257	0.44
					12,341,402	3.91
ANLEIHEN INSGESAMT					275,628,137	87.26
KURZFRISTIGE ANLEIHEN						
ÜBERSTAATLICHE EMITTENTEN						
European Union Bill (kurzfristige EU-Anleihe)	0.00%	05/04/24	EUR	5,770	5,715,517	1.81
KURZFRISTIGE ANLEIHEN INSGESAMT					5,715,517	1.81
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt					281,343,654	89.07
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
IRLAND						
Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC	4.88%	15/07/28	GBP	1,830	1,949,642	0.62
ITALIEN						
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	2.63%	28/04/25	EUR	2,080	2,030,532	0.64
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA, VRB	7.71%	18/01/28	EUR	1,897	1,901,862	0.60
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA, VRB	8.50%	10/09/30	EUR	1,171	1,180,310	0.37
Nexi SpA	1.75%	31/10/24	EUR	1,268	1,245,100	0.40
Nexi SpA	1.63%	30/04/26	EUR	1,104	1,049,812	0.33
Telecom Italia SpA/Milano	4.00%	11/04/24	EUR	788	786,218	0.25
Telecom Italia SpA/Milano	1.63%	18/01/29	EUR	1,704	1,477,470	0.47
					9,671,304	3.06
LUXEMBURG						
Altice France Holding SA 144A	10.50%	15/05/27	USD	1,273	747,493	0.23
NIEDERLANDE						
Summer BidCo BV, PIK	9.00%	15/11/25	EUR	793	789,433	0.25

BlueBay Funds – BlueBay High Yield ESG Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
NIEDERLANDE (Fortsetzung)						
Summer BidCo BV, PIK	9.00%	15/11/25	EUR	507	504,852	0.16
					<u>1,294,285</u>	<u>0.41</u>
SPANIEN						
Green Bidco SA	10.25%	15/07/28	EUR	2,068	1,819,540	0.58
Tendam Brands SAU, FRB	11.45%	31/03/28	EUR	406	413,630	0.13
					<u>2,233,170</u>	<u>0.71</u>
VEREINIGTE STAATEN						
Encore Capital Group Inc	4.88%	15/10/25	EUR	1,265	1,266,991	0.40
Voyager Aviation Holdings LLC 144A *	8.50%	09/05/26	USD	850	631,097	0.20
					<u>1,898,088</u>	<u>0.60</u>
ANLEIHEN INSGESAMT					17,793,982	5.63
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt					17,793,982	5.63
Sonstige Wertpapiere						
ANLEIHEN						
AUSTRALIEN						
Quintis Australia Pty Ltd 144A, PIK ^a	7.50%	01/10/26	USD	2,628	685,147	0.21
Quintis Australia Pty Ltd 144A, PIK ^a	0.00%	01/10/28	USD	1,552	0	0.00
					<u>685,147</u>	<u>0.21</u>
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Fagus Holdco Plc	0.00%	05/09/29	EUR	27	22,566	0.01
					<u>22,566</u>	<u>0.01</u>
TOTAL BONDS					707,713	0.22
STAMMAKTIEN						
AUSTRALIEN						
Quintis ^a			USD	985	0	0.00
					<u>0</u>	<u>0.00</u>
LUXEMBURG						
Lecta SA			EUR	13,801	276,020	0.09
					<u>276,020</u>	<u>0.09</u>
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Haya Holdco 1 Ltd			GBP	3	2,166	0.00
					<u>2,166</u>	<u>0.00</u>
STAMMAKTIEN INSGESAMT					278,186	0.09
OPTIONSSCHEINE						
MEXIKO						
Urbi Warrant			MXN	191	0	0.00
					<u>0</u>	<u>0.00</u>
OPTIONSSCHEINE INSGESAMT					0	0.00
Sonstige Wertpapiere insgesamt					985,899	0.31

BlueBay Funds – BlueBay High Yield ESG Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Anlagen insgesamt <i>(Kosten EUR 303,906,289)</i>	300,123,535	95.01
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten	15,728,603	4.99
Nettovermögen insgesamt	315,852,138	100.00

Glossar:

FTB - Flat Trading Bond (pauschal gehandelte Anleihe)

FRB - Floating Rate Bond (Anleihe mit variablem Zins)

PIK - Payment-in-Kind (Sachleistung)

S/U - Step Up Bond

VRB - Variable Rate Bond (variabel verzinsliche Anleihe)

± notleidendes Wertpapier

† Unbefristete Laufzeit

^ Fälligkeitsdatum ist der 09. Dezember 3019

α Wertpapier zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.
Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.
Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
AUSTRALIEN						
APA Infrastructure Ltd	1.25%	15/03/33	EUR	17,503	14,178,814	0.65
Transurban Finance Co. Pty Ltd	4.23%	26/04/33	EUR	19,297	20,345,844	0.94
					34,524,658	1.59
ÖSTERREICH						
A1 Towers Holding GmbH	5.25%	13/07/28	EUR	5,000	5,301,898	0.24
BELGIEN						
FLUVIUS System Operator CVBA	3.88%	09/05/33	EUR	20,000	20,710,502	0.95
Proximus SADP	4.13%	17/11/33	EUR	8,000	8,542,934	0.39
					29,253,436	1.34
KANADA						
Fairfax Financial Holdings Ltd	2.75%	29/03/28	EUR	15,461	14,766,504	0.68
Magna International Inc	4.38%	17/03/32	EUR	13,416	14,328,812	0.66
					29,095,316	1.34
DÄNEMARK						
Danske Bank, VRB	4.75%	21/06/30	EUR	8,802	9,292,417	0.43
Orsted AS	3.63%	01/03/26	EUR	13,444	13,511,920	0.62
TDC Net	5.62%	06/02/30	EUR	11,466	11,849,290	0.54
Vestas Wind Systems	4.13%	15/06/31	EUR	21,275	21,989,493	1.01
					56,643,120	2.60
FINNLAND						
Fortum Oyj	4.50%	26/05/33	EUR	9,709	10,327,439	0.47
Nordea Bank Abp, VRB	3.63%	10/02/26	EUR	13,215	13,187,663	0.61
Sanoma Oyj	0.63%	18/03/24	EUR	17,700	17,572,904	0.81
					41,088,006	1.89
FRANKREICH						
Atos SE	1.00%	12/11/29	EUR	8,000	4,370,109	0.20
AXA SA, VRB	4.25%	10/03/43	EUR	11,953	11,848,605	0.55
Banque Federative du Credit Mutuel SA	4.38%	02/05/30	EUR	15,800	16,445,030	0.76
Banque Federative du Credit Mutuel SA	4.75%	10/11/31	EUR	12,000	12,754,085	0.59
Banque Federative du Credit Mutuel SA	3.75%	01/02/33	EUR	14,600	14,936,590	0.69
BNP Paribas SA	1.38%	28/05/29	EUR	26,000	23,432,031	1.08
BNP Paribas SA, VRB	4.75%	13/11/32	EUR	19,100	20,287,549	0.93
BNP Paribas SA 144A, VRB	7.75%	31/12/49†	USD	9,299	8,621,153	0.40
BPCE SA	4.50%	13/01/33	EUR	21,300	22,446,402	1.03
BPCE SA, VRB	5.75%	01/06/33	EUR	2,900	3,069,041	0.14
BPCE SA, VRB	4.75%	14/06/34	EUR	7,600	8,105,616	0.37
BPCE SA, VRB	2.13%	13/10/46	EUR	13,200	10,758,413	0.49
Credit Agricole SA	3.88%	20/04/31	EUR	9,500	9,829,196	0.45
Credit Agricole SA	4.00%	18/01/33	EUR	9,800	10,323,471	0.47
Credit Agricole SA	4.38%	27/11/33	EUR	8,300	8,735,112	0.40
Electricite de France SA	4.63%	25/01/43	EUR	17,600	18,574,880	0.85
Electricite de France SA, VRB	7.50%	31/12/49†	EUR	9,600	10,510,988	0.48
Electricite de France SA, VRB	9.13%	31/12/49†	USD	5,287	5,343,824	0.25
Electricite de France SA, VRB	3.38%	31/12/49†	EUR	5,600	4,920,115	0.23
Electricite de France SA, VRB	4.00%	31/12/49†	EUR	4,100	4,074,056	0.19
Electricite de France SA, VRB	5.88%	31/12/49†	GBP	11,600	12,279,445	0.56
Electricite de France SA, VRB	6.00%	31/12/49†	GBP	6,300	7,095,732	0.33
Engie SA	4.25%	06/09/34	EUR	10,700	11,367,050	0.52
Engie SA	4.50%	06/09/42	EUR	7,300	7,880,192	0.36

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
FRANKREICH (Fortsetzung)						
Indigo Group SAS	4.50%	18/04/30	EUR	21,800	22,683,351	1.04
Lagardere SA	1.75%	07/10/27	EUR	25,000	24,957,976	1.15
Societe Generale SA, VRB	4.88%	21/11/31	EUR	11,500	12,043,562	0.55
Suez SACA	2.88%	24/05/34	EUR	12,400	11,606,315	0.53
TDF Infrastructure SASU	2.50%	07/04/26	EUR	10,600	10,349,616	0.48
TDF Infrastructure SASU	5.63%	21/07/28	EUR	12,400	13,045,212	0.60
TotalEnergies SE, VRB	2.63%	31/12/49†	EUR	15,953	15,616,352	0.72
Ubisoft Entertainment SA	0.88%	24/11/27	EUR	11,600	9,871,229	0.45
					388,182,298	17.84
DEUTSCHLAND						
Allianz SE, VRB	5.82%	25/07/53	EUR	11,300	12,396,910	0.57
Bayer AG	4.63%	26/05/33	EUR	14,188	14,832,308	0.68
Bayer AG, VRB	6.63%	25/09/83	EUR	8,300	8,468,678	0.39
Bayer AG, VRB	7.00%	25/09/83	EUR	7,400	7,657,812	0.35
Bundesobligation	2.20%	13/04/28	EUR	31,477	31,776,340	1.46
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.50%	15/02/26	EUR	4,525	4,360,280	0.20
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.25%	15/02/27	EUR	94,550	89,550,196	4.12
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.50%	15/02/28	EUR	11,354	10,723,399	0.49
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.25%	15/02/29	EUR	6,408	5,907,593	0.27
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.00%	15/08/29	EUR	1,070	964,219	0.05
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	2.30%	15/02/33	EUR	16,300	16,732,113	0.77
Commerzbank AG, VRB	6.13%	31/12/49†	EUR	8,400	8,139,389	0.37
Commerzbank AG, VRB	6.50%	31/12/49†	EUR	3,800	3,616,392	0.17
Deutsche Bank AG, VRB	10.00%	31/12/49†	EUR	5,000	5,464,611	0.25
Deutsche Bank AG, VRB	1.75%	19/11/30	EUR	16,500	14,366,208	0.66
Deutsche Börse AG	3.88%	28/09/33	EUR	15,400	16,422,150	0.76
EnBW Energie Baden- Württemberg AG, VRB	1.38%	31/08/81	EUR	2,000	1,710,780	0.08
Eurogrid GmbH	3.72%	27/04/30	EUR	25,000	25,545,509	1.17
O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH	1.75%	05/07/25	EUR	10,800	10,519,665	0.48
Volkswagen Leasing GmbH	4.75%	25/09/31	EUR	10,476	11,172,666	0.51
Vonovia SE	5.00%	23/11/30	EUR	9,000	9,535,271	0.44
					309,862,489	14.24
IRLAND						
Johnson Controls International Plc	4.25%	23/05/35	EUR	9,524	10,118,497	0.47
ITALIEN						
ASTM SpA	1.50%	25/01/30	EUR	8,228	7,174,902	0.33
ASTM SpA	2.38%	25/11/33	EUR	9,207	7,757,925	0.36
Autostrade per l'Italia SpA	2.00%	04/12/28	EUR	9,607	8,843,293	0.40
Autostrade per l'Italia SpA	2.00%	15/01/30	EUR	16,587	14,751,195	0.68
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	9.13%	31/12/49†	EUR	7,853	8,655,866	0.40
					47,183,181	2.17
JAPAN						
East Japan Railway Co	3.25%	08/09/30	EUR	11,075	11,232,562	0.52
East Japan Railway Co	4.11%	22/02/43	EUR	6,495	6,876,305	0.31
					18,108,867	0.83

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
JERSEY						
Heathrow Funding Ltd	4.50%	11/07/33	EUR	11,877	12,662,176	0.58
LUXEMBURG						
Aroundtown SA	0.38%	15/04/27	EUR	13,800	11,131,745	0.51
Aroundtown SA	1.63%	31/01/28	EUR	6,300	5,130,297	0.23
Aroundtown SA	1.45%	09/07/28	EUR	3,600	2,812,376	0.13
Eurofins Scientific SE	4.00%	06/07/29	EUR	17,771	18,044,304	0.83
Eurofins Scientific SE, VRB	6.75%	31/12/49†	EUR	8,690	9,049,738	0.42
Medtronic Global Holdings SCA	1.50%	02/07/39	EUR	1,127	862,962	0.04
Medtronic Global Holdings SCA	1.63%	15/10/50	EUR	9,770	6,684,166	0.31
Prologis International Funding II SA	1.63%	17/06/32	EUR	11,231	9,462,567	0.43
Simon International Finance SCA	1.13%	19/03/33	EUR	12,015	9,760,338	0.45
					72,938,493	3.35
NIEDERLANDE						
Abertis Infraestructuras Finance BV, VRB	2.63%	31/12/49†	EUR	6,500	5,939,799	0.27
Abertis Infraestructuras Finance BV, VRB	3.25%	31/12/49†	EUR	8,300	7,983,173	0.37
Cooperatieve Rabobank UA, VRB	4.88%	31/12/49†	EUR	4,400	3,982,039	0.18
Cooperatieve Rabobank UA, VRB ELM BV for Firmenich	4.38%	31/12/49†	EUR	13,600	12,765,460	0.59
International SA, VRB	3.75%	31/12/49†	EUR	15,668	15,376,160	0.71
EnBW International Finance BV	4.30%	23/05/34	EUR	14,068	14,899,751	0.68
EnBW International Finance BV	4.00%	24/01/35	EUR	13,897	14,373,908	0.66
ING Groep NV, VRB	4.75%	23/05/34	EUR	18,300	19,521,873	0.90
JAB Holdings BV	5.00%	12/06/33	EUR	15,500	16,743,932	0.77
Lseg Netherlands BV	4.23%	29/09/30	EUR	14,869	15,715,036	0.72
Prosus NV	1.29%	13/07/29	EUR	7,896	6,426,936	0.30
Prosus NV	1.99%	13/07/33	EUR	10,882	8,077,346	0.37
Telefonica Europe BV, VRB	2.38%	31/12/49†	EUR	3,100	2,699,150	0.12
Telefonica Europe BV, VRB	6.14%	31/12/49†	EUR	800	825,380	0.04
TenneT Holding BV	4.25%	28/04/32	EUR	7,099	7,708,541	0.35
TenneT Holding BV	4.50%	28/10/34	EUR	7,098	7,903,815	0.36
Thermo Fisher Scientific Finance I BV	1.63%	18/10/41	EUR	8,593	6,502,035	0.30
Thermo Fisher Scientific Finance I BV	2.00%	18/10/51	EUR	6,001	4,314,209	0.20
Upjohn Finance BV	1.91%	23/06/32	EUR	17,911	15,094,149	0.69
Volkswagen International Finance NV, VRB	3.88%	31/12/49†	EUR	4,800	4,585,481	0.21
Volkswagen International Finance NV, VRB	4.63%	31/12/49†	EUR	2,600	2,522,493	0.12
Wintershall Dea Finance 2 BV, VRB	2.50%	31/12/49†	EUR	11,400	10,396,764	0.48
Wintershall Dea Finance 2 BV, VRB	3.00%	31/12/49†	EUR	12,700	11,121,823	0.51
Wintershall Dea Finance BV	1.82%	25/09/31	EUR	6,700	5,763,386	0.27
					221,242,639	10.17
NORWEGEN						
Variable Energi ASA, VRB	7.86%	15/11/83	EUR	11,600	12,372,571	0.57
SLOWAKEI						
Zapadoslovenska Energetika AS	1.75%	02/03/28	EUR	2,951	2,766,857	0.13
SPANIEN						
Abertis Infraestructuras SA	3.38%	27/11/26	GBP	2,900	3,197,356	0.15
Abertis Infraestructuras SA	4.13%	07/08/29	EUR	10,500	10,800,584	0.50
Banco Santander SA	4.88%	18/10/31	EUR	16,000	17,061,451	0.78

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
SPANIEN (Fortsetzung)						
CaixaBank SA	4.38%	29/11/33	EUR	10,600	11,163,130	0.51
CaixaBank SA, VRB	5.00%	19/07/29	EUR	3,200	3,350,561	0.15
CaixaBank SA, VRB	5.13%	19/07/34	EUR	18,000	19,261,159	0.89
CaixaBank SA, VRB	5.88%	31/12/49†	EUR	7,000	6,796,042	0.31
EDP Servicios Financieros Espana SA	4.38%	04/04/32	EUR	8,231	8,781,929	0.40
FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU	5.25%	30/10/29	EUR	10,457	11,240,476	0.52
Werfen SA/Spanien	4.63%	06/06/28	EUR	12,600	12,861,296	0.59
					104,513,984	4.80
SCHWEDEN						
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, VRB	2.62%	31/12/49†	EUR	883	144,799	0.01
SCHWEIZ						
UBS AG	5.13%	15/05/24	USD	18,875	16,961,278	0.78
UBS Group AG, VRB	3.25%	02/04/26	EUR	10,595	10,503,506	0.48
UBS Group AG, VRB	7.75%	01/03/29	EUR	19,625	22,639,677	1.04
UBS Group AG, VRB	2.88%	02/04/32	EUR	27,560	25,795,715	1.19
					75,900,176	3.49
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Barclays Plc, VRB	8.88%	31/12/49†	GBP	1,217	1,403,382	0.06
Barclays Plc, VRB	9.25%	31/12/49†	GBP	7,017	8,088,226	0.37
Barclays Plc, VRB	8.41%	14/11/32	GBP	4,431	5,460,147	0.25
Barclays Plc, VRB	5.26%	29/01/34	EUR	14,341	15,389,303	0.71
Barclays Plc, VRB	6.38%	31/12/49†	GBP	6,386	7,032,791	0.32
DS Smith Plc	4.38%	27/07/27	EUR	12,147	12,507,690	0.57
DS Smith Plc	4.50%	27/07/30	EUR	9,903	10,332,387	0.48
HSBC Holdings Plc, VRB	4.79%	10/03/32	EUR	7,547	7,997,123	0.37
HSBC Holdings Plc, VRB	6.80%	14/09/31	GBP	15,278	19,044,099	0.88
HSBC Holdings Plc, VRB	4.86%	23/05/33	EUR	15,993	16,994,172	0.78
Inchcape Plc	6.50%	09/06/28	GBP	2,300	2,765,471	0.13
ITV Plc	1.38%	26/09/26	EUR	10,975	10,347,162	0.48
London Stock Exchange Group Plc	0.88%	19/09/24	EUR	5,972	5,850,940	0.27
National Gas Transmission Plc	4.25%	05/04/30	EUR	16,439	17,088,536	0.79
National Grid Electricity Distribution East Midlands Plc	3.95%	20/09/32	EUR	10,633	10,965,644	0.50
National Grid Electricity Distribution West Midlands Plc	3.88%	17/10/24	GBP	8,664	9,869,116	0.45
Nationwide Building Society, VRB	5.75%	31/12/49†	GBP	3,372	3,598,122	0.17
NatWest Group Plc, VRB	4.77%	16/02/29	EUR	13,409	13,957,928	0.64
NatWest Group Plc, VRB	6.00%	31/12/49†	USD	1,463	1,286,982	0.06
Northumbrian Water Finance Plc	4.50%	14/02/31	GBP	9,930	11,059,950	0.51
Swiss Re Finance UK Plc, VRB	2.71%	04/06/52	EUR	7,200	6,412,114	0.29
					197,451,285	9.08
VEREINIGTE STAATEN						
AT&T Inc	3.95%	30/04/31	EUR	11,309	11,758,248	0.54
AT&T Inc	4.30%	18/11/34	EUR	9,920	10,497,783	0.48
Carrier Global Corp	4.50%	29/11/32	EUR	5,468	5,855,816	0.27
Computershare US Inc	1.13%	07/10/31	EUR	12,798	10,037,491	0.46
Euronet Worldwide Inc	1.38%	22/05/26	EUR	11,028	10,366,666	0.48
Global Payments Inc	4.88%	17/03/31	EUR	15,130	15,921,786	0.73
National Grid North America Inc	4.67%	12/09/33	EUR	21,915	23,429,472	1.08
Revvity Inc	1.88%	19/07/26	EUR	7,684	7,414,634	0.34
Toyota Motor Credit Corp	4.05%	13/09/29	EUR	26,753	28,101,806	1.29
Utah Acquisition Sub Inc	2.25%	22/11/24	EUR	11,798	11,597,411	0.53
Utah Acquisition Sub Inc	3.13%	22/11/28	EUR	2,602	2,537,604	0.12

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)						
Veralto Corp	4.15%	19/09/31	EUR	10,800	11,248,491	0.52
					148,767,208	6.84
ANLEIHEN INSGESAMT					1,818,121,954	83.57
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt					1,818,121,954	83.57
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
KAIMANINSELN						
Avolon Holdings Funding Ltd 144A	5.25%	15/05/24	USD	14,600	13,148,233	0.60
Avolon Holdings Funding Ltd 144A	3.95%	01/07/24	USD	14,988	13,408,431	0.62
					26,556,664	1.22
FRANKREICH						
Electricite de France SA 144A	6.90%	23/05/53	USD	7,088	7,289,006	0.33
Societe Generale SA, VRB	9.38%	31/12/49†	USD	6,362	6,022,958	0.28
					13,311,964	0.61
DEUTSCHLAND						
Deutsche Bank AG/New York NY, VRB	3.55%	18/09/31	USD	7,304	5,812,365	0.27
Robert Bosch GmbH	4.00%	02/06/35	EUR	10,500	11,153,419	0.51
Robert Bosch GmbH	4.38%	02/06/43	EUR	13,200	14,184,978	0.65
					31,150,762	1.43
ITALIEN						
Intesa Sanpaolo SpA	5.13%	29/08/31	EUR	10,621	11,341,583	0.52
Intesa Sanpaolo SpA	5.63%	08/03/33	EUR	13,621	14,703,628	0.68
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	7.75%	31/12/49†	EUR	11,701	12,027,214	0.55
Intesa Sanpaolo SpA 144A, VRB	8.25%	21/11/33	USD	11,310	11,150,791	0.51
Intesa Sanpaolo SpA 144A, VRB	4.95%	01/06/42	USD	12,243	7,916,526	0.37
					57,139,742	2.63
JAPAN						
East Japan Railway Co	4.39%	05/09/43	EUR	2,456	2,672,059	0.12
Nissan Motor Co Ltd 144A	4.81%	17/09/30	USD	8,114	6,877,783	0.32
					9,549,842	0.44
LUXEMBURG						
Bevco Lux Sarl	1.00%	16/01/30	EUR	15,835	13,282,795	0.61
NIEDERLANDE						
Enel Finance International NV 144A	7.75%	14/10/52	USD	5,319	5,949,979	0.27
JDE Peet's NV	4.50%	23/01/34	EUR	1,769	1,859,682	0.09
Sartorius Finance BV	4.38%	14/09/29	EUR	7,800	8,095,570	0.37
Sartorius Finance BV	4.50%	14/09/32	EUR	5,800	6,059,480	0.28
Sartorius Finance BV	4.88%	14/09/35	EUR	5,800	6,130,699	0.28
					28,095,410	1.29
SPANIEN						
CaixaBank SA 144A, VRB	6.84%	13/09/34	USD	18,567	17,755,307	0.82

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
SCHWEIZ						
Credit Suisse Group AG, FTB ^{±#}	9.75%	31/12/49†	USD	5,790	628,978	0.03
UBS Group AG 144A, VRB	9.02%	15/11/33	USD	2,830	3,153,484	0.14
					3,782,462	0.17
VEREINIGTE STAATEN						
Amgen Inc	5.65%	02/03/53	USD	7,379	7,046,303	0.32
Amgen Inc	5.75%	02/03/63	USD	8,720	8,314,990	0.38
Bayer US Finance LLC 144A	6.50%	21/11/33	USD	10,930	10,207,238	0.47
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	4.40%	01/12/61	USD	16,142	10,151,309	0.47
Intel Corp	5.70%	10/02/53	USD	9,029	8,860,150	0.41
Volkswagen Group of America Finance LLC 144A	5.90%	12/09/33	USD	2,840	2,670,413	0.12
Warnermedia Holdings Inc	5.05%	15/03/42	USD	10,845	8,667,012	0.40
Warnermedia Holdings Inc	5.14%	15/03/52	USD	14,379	11,212,818	0.51
Warnermedia Holdings Inc	5.39%	15/03/62	USD	9,390	7,317,767	0.34
					74,448,000	3.42
ANLEIHEN INSGESAMT					275,072,948	12.64
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt					275,072,948	12.64
Anlagen insgesamt (Kosten EUR 2,081,365,313)					2,093,194,902	96.21
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					82,390,269	3.79
Nettovermögen insgesamt					2,175,585,171	100.00

Glossar:

FTB - Flat Trading Bond (pauschal gehandelte Anleihe)

VRB - Variable Rate Bond (variabel verzinsliche Anleihe)

± notleidendes Wertpapier

† Unbefristete Laufzeit

Die Investition stellt eine zum beizulegenden Zeitwert bewertete Forderung dar

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.

Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
BRASILIEN						
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F ^Ω	10.00%	01/01/27	BRL	1,273	276,205	1.20
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F ^Ω	10.00%	01/01/29	BRL	1,928	414,747	1.81
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F ^Ω	10.00%	01/01/31	BRL	1,187	253,584	1.10
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	10.00%	01/01/33	BRL	2,912	589,187	2.57
					1,533,723	6.68
CHILE						
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos	6.00%	01/01/43	CLP	105,000	130,779	0.57
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 144A ^Ω	4.70%	01/09/30	CLP	200,000	224,347	0.98
					355,126	1.55
KOLUMBIEN						
Kolumbianische TES	2.25%	18/04/29	COP	1,752,927	422,134	1.84
Kolumbianische TES	13.25%	09/02/33	COP	1,820,500	559,771	2.44
Kolumbianische TES	6.25%	09/07/36	COP	3,194,600	603,313	2.63
Kolumbianische TES	9.25%	28/05/42	COP	687,200	161,678	0.70
Empresas Publicas de Medellin ESP	8.38%	08/11/27	COP	1,127,000	249,026	1.08
					1,995,922	8.69
TSCHECHISCHE REPUBLIK						
Tschechische Staatsanleihe	0.95%	15/05/30	CZK	4,570	173,057	0.75
Tschechische Staatsanleihe	2.00%	13/10/33	CZK	18,930	728,831	3.18
					901,888	3.93
DOMINIKANISCHE REPUBLIK						
Dominikanische internationale Staatsanleihe	13.63%	03/02/33	DOP	23,000	481,862	2.10
UNGARN						
Ungarische Staatsanleihe	4.75%	24/11/32	HUF	174,320	465,331	2.03
INDONESIEN						
Indonesische Schatzanweisung	7.00%	15/02/33	IDR	10,691,000	721,089	3.14
Indonesische Schatzanweisung	8.38%	15/03/34	IDR	11,108,000	816,669	3.56
Indonesische Schatzanweisung	7.13%	15/06/38	IDR	11,347,000	772,704	3.36
					2,310,462	10.06
MEXIKO						
America Movil SAB de CV	9.50%	27/01/31	MXN	6,500	372,691	1.62
Mexikanische Anleihen	7.75%	29/05/31	MXN	6,890	380,412	1.66
Mexikanische Anleihen	8.50%	18/11/38	MXN	14,770	834,540	3.63
Mexikanische Anleihen	7.75%	13/11/42	MXN	8,520	444,638	1.94
Petroleos Mexicanos	7.19%	12/09/24	MXN	4,200	238,224	1.04
					2,270,505	9.89
PERU						
Peruanische Staatsanleihe	6.15%	12/08/32	PEN	1,230	324,563	1.41

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
PERU (Fortsetzung)						
Peruanische Staatsanleihe 144A	7.30%	12/08/33	PEN	3,537	1,000,780	4.36
					<u>1,325,343</u>	<u>5.77</u>
POLEN						
Polnische Staatsanleihe	2.75%	25/10/29	PLN	1,559	354,313	1.54
Polnische Staatsanleihe	1.75%	25/04/32	PLN	3,110	615,696	2.68
					<u>970,009</u>	<u>4.22</u>
RUMÄNIEN						
Rumänische Staatsanleihe	8.75%	30/10/28	RON	2,315	567,043	2.47
Rumänische Staatsanleihe	4.25%	28/04/36	RON	2,710	499,842	2.18
					<u>1,066,885</u>	<u>4.65</u>
SÜDAFRIKA						
Eskom Holdings SOC Ltd	8.50%	25/04/42	ZAR	2,000	73,272	0.32
Südafrikanische Staatsanleihe	8.25%	31/03/32	ZAR	13,028	622,571	2.71
Südafrikanische Staatsanleihe	8.50%	31/01/37	ZAR	14,316	610,936	2.66
Südafrikanische Staatsanleihe	6.50%	28/02/41	ZAR	15,612	517,103	2.25
Südafrikanische Staatsanleihe	8.75%	31/01/44	ZAR	4,334	175,826	0.77
					<u>1,999,708</u>	<u>8.71</u>
TÜRKEI						
Türkische Staatsanleihe	0.00%	19/07/28	TRY	1,109	38,213	0.17
URUGUAY						
Uruguayische internationale Staatsanleihe	9.75%	20/07/33	UYU	8,049	209,315	0.91
ANLEIHEN INSGESAMT					15,924,292	69.36
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt					15,924,292	69.36
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
CHINA						
China Development Bank	3.48%	08/01/29	CNY	1,050	154,507	0.68
Chinesische Staatsanleihe	3.13%	21/11/29	CNY	13,750	2,009,345	8.75
					<u>2,163,852</u>	<u>9.43</u>
MALAYSIA						
Malaysische Staatsanleihe	3.89%	15/08/29	MYR	1,555	342,122	1.49
Malaysische Staatsanleihe	3.84%	15/04/33	MYR	2,824	615,503	2.68
Malaysische Staatsanleihe	4.07%	15/06/50	MYR	1,362	287,517	1.25
					<u>1,245,142</u>	<u>5.42</u>
THAILAND						
Thailändische Staatsanleihe	3.65%	20/06/31	THB	17,158	537,527	2.34

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
THAILAND (Fortsetzung)						
Thailändische Staatsanleihe	3.30%	17/06/38	THB	20,000	606,190	2.64
					1,143,717	4.98
ANLEIHEN INSGESAMT					4,552,711	19.83
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt					4,552,711	19.83
Anlagen insgesamt <i>(Kosten USD 20,217,468)</i>					20,477,003	89.19
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					2,483,935	10.81
Nettovermögen insgesamt					22,960,938	100.00

Glossar:

FTB - Flat Trading Bond (pauschal gehandelte Anleihe)

Ω Wertpapier mit „Dirty Price“ bewertet

β Die Anlage stellt ein offenstehendes Geschäft nach dem Fälligkeitsdatum dar

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.
Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.
Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Select Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
ANGOLA						
Angolanische internationale Staatsanleihe	8.25%	09/05/28	USD	444	410,700	0.48
Angolanische internationale Staatsanleihe	8.75%	14/04/32	USD	224	198,520	0.23
					609,220	0.71
ARGENTINIEN						
Argentinische internationale Staatsanleihe, S/U	3.63%	09/07/35	USD	1,799	613,544	0.71
Argentinische internationale Staatsanleihe, S/U	3.50%	09/07/41	USD	238	81,235	0.09
					694,779	0.80
KAIMANINSELN						
EDO Sukuk Ltd	5.88%	21/09/33	USD	370	382,083	0.44
CHILE						
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 144A ^Ω	4.70%	01/09/30	CLP	620,000	695,476	0.81
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 144A	5.30%	01/11/37	CLP	860,000	974,183	1.13
Chilenische internationale Staatsanleihe	3.10%	07/05/41	USD	200	152,400	0.18
Chilenische internationale Staatsanleihe	5.33%	05/01/54	USD	700	697,922	0.81
Corp. Nacional del Cobre de Chile	5.13%	02/02/33	USD	200	193,840	0.22
Corp. Nacional del Cobre de Chile	5.95%	08/01/34	USD	616	625,388	0.72
Corp. Nacional del Cobre de Chile	6.30%	08/09/53	USD	264	267,854	0.31
					3,607,063	4.18
KOLUMBIEN						
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	8.00%	20/04/33	USD	725	793,988	0.92
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	8.75%	14/11/53	USD	540	621,928	0.72
Kolumbianische TES	2.25%	18/04/29	COP	10,338,262	2,489,625	2.89
Kolumbianische TES	7.00%	30/06/32	COP	1,320,800	285,871	0.33
Kolumbianische TES	13.25%	09/02/33	COP	1,070,100	329,036	0.38
Kolumbianische TES	9.25%	28/05/42	COP	6,269,300	1,474,985	1.71
Ecopetrol SA	8.88%	13/01/33	USD	320	348,000	0.40
Ecopetrol SA	5.88%	02/11/51	USD	305	231,991	0.27
					6,575,424	7.62
COSTA RICA						
Costa-ricanische internationale Staatsanleihe	7.30%	13/11/54	USD	450	489,604	0.57
TSCHECHISCHE REPUBLIK						
Tschechische Staatsanleihe	0.95%	15/05/30	CZK	13,770	521,442	0.60
Tschechische Staatsanleihe	2.00%	13/10/33	CZK	17,380	669,154	0.78
					1,190,596	1.38
DOMINIKANISCHE REPUBLIK						
Dominikanische internationale Staatsanleihe	5.50%	27/01/25	USD	385	383,739	0.44
Dominikanische internationale Staatsanleihe	5.95%	25/01/27	USD	138	138,770	0.16

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Select Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
DOMINIKANISCHE REPUBLIK (Fortsetzung)						
Dominikanische internationale Staatsanleihe	6.00%	19/07/28	USD	150	150,600	0.17
Dominikanische internationale Staatsanleihe	7.05%	03/02/31	USD	350	368,412	0.43
Dominikanische internationale Staatsanleihe	4.88%	23/09/32	USD	260	237,261	0.28
Dominikanische internationale Staatsanleihe	13.63%	03/02/33	DOP	44,550	933,346	1.08
Dominikanische internationale Staatsanleihe	11.25%	15/09/35	DOP	18,750	349,400	0.41
					2,561,528	2.97
ECUADOR						
Ecuadorianische internationale Staatsanleihe, S/U	3.50%	31/07/35	USD	413	148,330	0.17
ÄGYPTEN						
Ägyptische internationale Staatsanleihe	5.25%	06/10/25	USD	200	183,500	0.22
Ägyptische internationale Staatsanleihe	6.59%	21/02/28	USD	294	226,426	0.26
Ägyptische internationale Staatsanleihe	7.30%	30/09/33	USD	375	248,906	0.29
Ägyptische internationale Staatsanleihe	7.90%	21/02/48	USD	771	467,178	0.54
Ägyptische internationale Staatsanleihe	8.70%	01/03/49	USD	510	320,981	0.37
					1,446,991	1.68
EL SALVADOR						
Internationale Staatsanleihe El Salvador	7.65%	15/06/35	USD	177	138,668	0.16
Internationale Staatsanleihe El Salvador	7.63%	01/02/41	USD	226	170,065	0.20
					308,733	0.36
GUATEMALA						
Guatemalteckische Staatsanleihe	6.60%	13/06/36	USD	415	428,487	0.50
UNGARN						
Ungarische Staatsanleihe	4.75%	24/11/32	HUF	296,360	791,106	0.92
INDONESIEN						
Indonesische internationale Staatsanleihe	4.20%	15/10/50	USD	403	363,770	0.42
Indonesische internationale Staatsanleihe	5.65%	11/01/53	USD	250	274,765	0.32
Indonesische Schatzanweisung	8.25%	15/05/29	IDR	14,288,000	1,003,603	1.16
Indonesische Schatzanweisung	8.75%	15/05/31	IDR	3,880,000	283,749	0.33
Indonesische Schatzanweisung	6.38%	15/04/32	IDR	7,856,000	505,637	0.59
Indonesische Schatzanweisung	8.38%	15/03/34	IDR	7,503,000	551,627	0.64
Indonesische Schatzanweisung	7.50%	15/06/35	IDR	9,542,000	666,521	0.77
Indonesische Schatzanweisung	7.13%	15/06/38	IDR	28,267,000	1,924,917	2.23
					5,574,589	6.46
IRAK						
Irakische internationale Staatsanleihe	5.80%	15/01/28	USD	452	423,810	0.49

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Select Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
JERSEY						
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd	2.94%	30/09/40	USD	1,253	1,037,790	1.20
KENIA						
Kenianische internationale Staatsanleihe	6.88%	24/06/24	USD	200	194,969	0.23
LIBANON						
Libanesische internationale Staatsanleihe *	6.38%	09/03/20 ^β	USD	2,604	162,750	0.19
Libanesische internationale Staatsanleihe *	5.80%	14/04/20 ^β	USD	468	29,250	0.03
Libanesische internationale Staatsanleihe *	6.15%	19/06/20 ^β	USD	936	58,500	0.07
Libanesische internationale Staatsanleihe *	8.25%	12/04/21 ^β	USD	537	33,395	0.04
Libanesische internationale Staatsanleihe *	8.25%	17/05/34	USD	500	31,250	0.03
					315,145	0.36
LUXEMBURG						
Greensaif Pipelines Bidco Sarl	6.13%	23/02/38	USD	490	512,969	0.59
MEXIKO						
America Movil SAB de CV	9.50%	27/01/31	MXN	20,820	1,193,759	1.38
Mexikanische Anleihen	7.75%	29/05/31	MXN	49,600	2,738,522	3.18
Mexikanische Anleihen	8.50%	18/11/38	MXN	8,300	468,970	0.54
Mexikanische Anleihen	7.75%	13/11/42	MXN	5,120	267,200	0.31
Mexico City Airport Trust	5.50%	31/07/47	USD	495	428,264	0.50
Mexikanische internationale Staatsanleihe	6.34%	04/05/53	USD	330	337,167	0.39
Mexikanische internationale Staatsanleihe	3.77%	24/05/61	USD	275	187,086	0.22
					5,620,968	6.52
NIGERIA						
Nigerianische internationale Staatsanleihe	6.13%	28/09/28	USD	435	387,014	0.45
Nigerianische internationale Staatsanleihe	7.38%	28/09/33	USD	200	171,188	0.20
					558,202	0.65
NORDMAZEDONIEN						
Nordmazedonische internationale Staatsanleihe	6.96%	13/03/27	EUR	360	416,114	0.48
OMAN						
Omanische internationale Staatsanleihe	4.88%	01/02/25	USD	769	764,194	0.88
Omanische internationale Staatsanleihe	6.75%	28/10/27	USD	961	1,016,858	1.18
Omanische internationale Staatsanleihe	6.75%	17/01/48	USD	1,255	1,316,377	1.53
					3,097,429	3.59
PAKISTAN						
Pakistanische internationale Staatsanleihe	6.00%	08/04/26	USD	418	297,368	0.35

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Select Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
PAKISTAN (Fortsetzung)						
Pakistanische internationale Staatsanleihe	7.38%	08/04/31	USD	565	347,033	0.40
Pakistanische internationale Staatsanleihe	7.88%	31/03/36	USD	100	63,625	0.07
					708,026	0.82
PARAGUAY						
Paraguayische internationale Staatsanleihe	4.95%	28/04/31	USD	200	195,950	0.23
Paraguayische internationale Staatsanleihe	5.40%	30/03/50	USD	482	431,510	0.50
					627,460	0.73
PERU						
Peruanische Staatsanleihe	6.15%	12/08/32	PEN	3,152	831,725	0.96
Peruanische Staatsanleihe 144A	7.30%	12/08/33	PEN	1,945	550,330	0.64
					1,382,055	1.60
PHILIPPINEN						
ROP Sukuk Trust	5.05%	06/06/29	USD	250	254,766	0.29
POLEN						
Bank Gospodarstwa Krajowego	5.38%	22/05/33	USD	330	335,346	0.39
Polnische Staatsanleihe	1.75%	25/04/32	PLN	7,389	1,462,824	1.69
Polnische internationale Staatsanleihe	5.50%	04/04/53	USD	245	256,365	0.30
					2,054,535	2.38
KATAR						
Katarische internationale Staatsanleihe	4.40%	16/04/50	USD	378	350,285	0.41
QatarEnergy	3.13%	12/07/41	USD	442	341,012	0.39
QatarEnergy	3.30%	12/07/51	USD	456	334,141	0.39
					1,025,438	1.19
RUMÄNIEN						
Rumänische Staatsanleihe	4.25%	28/04/36	RON	7,870	1,451,571	1.68
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.63%	02/12/40	EUR	445	331,767	0.39
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.75%	14/04/41	EUR	1,668	1,240,529	1.44
					3,023,867	3.51
SERBIEN						
Serbische internationale Anleihe	6.25%	26/05/28	USD	227	232,925	0.27
Serbische internationale Anleihe	6.50%	26/09/33	USD	200	205,458	0.24
Serbische internationale Anleihe	2.05%	23/09/36	EUR	625	482,652	0.56
					921,035	1.07
SÜDAFRIKA						
Eskom Holdings SOC Ltd	7.13%	11/02/25	USD	200	200,406	0.23

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Select Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
SÜDAFRIKA (Fortsetzung)						
Südafrikanische Staatsanleihe	8.00%	31/01/30	ZAR	30,367	1,528,662	1.77
Südafrikanische Staatsanleihe	7.00%	28/02/31	ZAR	10,676	489,231	0.57
Südafrikanische Staatsanleihe	8.25%	31/03/32	ZAR	13,419	641,257	0.74
Südafrikanische Staatsanleihe	6.50%	28/02/41	ZAR	20,325	673,207	0.78
Südafrikanische Staatsanleihe	8.75%	28/02/48	ZAR	5,855	235,960	0.27
Südafrikanische internationale Staatsanleihe	5.88%	20/04/32	USD	280	266,084	0.31
Südafrikanische internationale Staatsanleihe	5.38%	24/07/44	USD	838	670,793	0.78
Südafrikanische internationale Staatsanleihe	5.00%	12/10/46	USD	215	159,503	0.19
Südafrikanische internationale Staatsanleihe	7.30%	20/04/52	USD	200	189,875	0.22
					5,054,978	5.86
SRI LANKA						
Sri-lankische internationale Staatsanleihe, FTB [±]	5.75%	18/04/23 ^β	USD	219	112,908	0.13
Sri-lankische internationale Staatsanleihe, FTB [±]	6.85%	14/03/24	USD	457	232,784	0.27
Sri-lankische internationale Staatsanleihe, FTB [±]	7.85%	14/03/29	USD	264	133,691	0.16
					479,383	0.56
TUNESIEN						
Tunesische Republik	5.63%	17/02/24	EUR	731	782,798	0.91
Tunesische Republik	5.75%	30/01/25	USD	315	258,989	0.30
					1,041,787	1.21
TÜRKEI						
Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS	8.51%	14/01/29	USD	450	478,350	0.55
Istanbul Metropolitan Municipality	10.75%	12/04/27	USD	370	391,980	0.45
Istanbul Metropolitan Municipality	10.50%	06/12/28	USD	290	308,879	0.36
Türkische Staatsanleihe	0.00%	19/07/28	TRY	1,994	68,694	0.08
Türkische internationale Staatsanleihe	4.88%	16/04/43	USD	2,108	1,545,533	1.79
Türkische internationale Staatsanleihe	5.75%	11/05/47	USD	669	524,329	0.61
Türkiye Ihracat Kredi Bankasi AS	9.00%	28/01/27	USD	200	208,781	0.24
Ziraat Katilim Varlik Kiralama AS	9.38%	12/11/26	USD	290	305,995	0.36
					3,832,541	4.44
UKRAINE						
Ukrainische internationale Staatsanleihe, FTB [±]	7.75%	01/09/28	USD	354	99,917	0.12
Ukrainische internationale Staatsanleihe, FTB [±]	7.38%	25/09/34	USD	1,683	401,816	0.46
Ukrainische internationale Staatsanleihe, FRB [±]	7.75%	01/08/41	USD	1,096	493,518	0.57
					995,251	1.15

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Select Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE						
Abu Dhabi internationale Staatsanleihe	3.00%	15/09/51	USD	735	526,984	0.61
Abu Dhabi internationale Staatsanleihe	2.70%	02/09/70	USD	334	212,416	0.25
Finanzministerium Sharjah	3.63%	10/03/33	USD	602	513,957	0.60
MDGH GMTN RSC Ltd	4.38%	22/11/33	USD	260	253,673	0.29
					1,507,030	1.75
VEREINIGTE STAATEN						
Schatzanweisung der Vereinigten Staaten	2.75%	15/02/24	USD	759	756,612	0.88
Schatzanweisung der Vereinigten Staaten	3.00%	30/06/24	USD	750	742,166	0.86
					1,498,778	1.74
URUGUAY						
Uruguayische internationale Staatsanleihe	9.75%	20/07/33	UYU	26,282	683,473	0.79
USBEKISTAN						
Usbekische internationale Staatsanleihe	7.85%	12/10/28	USD	580	607,369	0.71
Usbekische internationale Staatsanleihe	3.90%	19/10/31	USD	250	210,391	0.24
Uzbekneftegaz JSC	4.75%	16/11/28	USD	426	355,510	0.41
					1,173,270	1.36
VENEZUELA						
Petroleos de Venezuela SA ±	8.50%	27/10/20 ^β	USD	1,107	880,705	1.02
Venezolanische internationale Staatsanleihe ±	7.75%	13/10/19 ^β	USD	920	127,766	0.15
Venezolanische internationale Staatsanleihe ±	12.75%	23/08/22 ^β	USD	350	57,586	0.07
Venezolanische internationale Staatsanleihe ±	8.25%	13/10/24	USD	1,274	191,130	0.22
					1,257,187	1.46
SAMBIA						
Sambische internationale Staatsanleihe, FTB ±	5.38%	20/09/22 ^β	USD	663	372,811	0.43
					64,879,600	75.21
ANLEIHEN INSGESAMT						
					64,879,600	75.21
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt						
					64,879,600	75.21
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
BRASILIEN						
Brasilianische internationale Staatsanleihe	6.25%	18/03/31	USD	610	634,080	0.74
KOLUMBIEN						
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	7.50%	02/02/34	USD	470	496,878	0.58
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	8.00%	14/11/35	USD	720	788,962	0.91

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Select Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
KOLUMBIEN (Fortsetzung)						
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	5.00%	15/06/45	USD	360	279,675	0.32
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	4.13%	15/05/51	USD	516	344,591	0.40
Ecopetrol SA	8.63%	19/01/29	USD	400	427,813	0.50
					2,337,919	2.71
EL SALVADOR						
Internationale Staatsanleihe El Salvador	6.38%	18/01/27	USD	307	271,503	0.31
MEXIKO						
Petroleos Mexicanos	5.63%	23/01/46	USD	344	209,582	0.24
Petroleos Mexicanos	6.35%	12/02/48	USD	2,228	1,418,768	1.65
Petroleos Mexicanos	6.95%	28/01/60	USD	55	36,300	0.04
					1,664,650	1.93
PANAMA						
Panamaische internationale Staatsanleihe	4.50%	01/04/56	USD	895	603,705	0.70
Panamaische internationale Staatsanleihe	3.87%	23/07/60	USD	350	210,383	0.24
					814,088	0.94
PARAGUAY						
Paraguayische internationale Staatsanleihe	5.85%	21/08/33	USD	470	480,223	0.56
PHILIPPINEN						
Philippinische internationale Staatsanleihe	5.50%	17/01/48	USD	250	263,594	0.31
THAILAND						
Thailändische Staatsanleihe	3.78%	25/06/32	THB	37,648	1,198,747	1.39
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE						
MDGH GMTN RSC Ltd	5.08%	22/05/53	USD	200	196,721	0.23
URUGUAY						
Uruguayische internationale Staatsanleihe	4.98%	20/04/55	USD	382	373,978	0.43
VENEZUELA						
Petroleos de Venezuela SA ‡	6.00%	15/11/26	USD	338	38,609	0.04
ANLEIHEN INSGESAMT					8,274,112	9.59
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt					8,274,112	9.59

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Select Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Anlagen insgesamt <i>(Kosten USD 75,569,781)</i>	73,153,712	84.80
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten	13,106,183	15.20
Nettovermögen insgesamt	86,259,895	100.00

Glossar:

FTB - Flat Trading Bond (pauschal gehandelte Anleihe)

FRB - Floating Rate Bond (Anleihe mit variablem Zins)

S/U - Step Up Bond

Ω Wertpapier mit „Dirty Price“ bewertet

± notleidendes Wertpapier

β Die Anlage stellt ein offenstehendes Geschäft nach dem Fälligkeitsdatum dar

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.
Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.
Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
ARGENTINIEN						
Argentinische internationale Staatsanleihe, S/U	3.50%	09/07/41	USD	1,195	408,095	0.22
Pampa Energia SA	7.50%	24/01/27	USD	701	684,789	0.37
					1,092,884	0.59
ÖSTERREICH						
Suzano Austria GmbH	6.00%	15/01/29	USD	704	718,630	0.39
Suzano Austria GmbH	3.75%	15/01/31	USD	709	623,366	0.33
					1,341,996	0.72
BERMUDA						
Investment Energy Resources Ltd	6.25%	26/04/29	USD	862	812,745	0.44
BRITISCHE JUNGFERNSSELN						
CAS Capital No 1 Ltd, VRB	4.00%	31/12/49†	USD	1,548	1,340,229	0.72
Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd	6.13%	15/05/29	USD	1,023	1,050,173	0.56
Studio City Finance Ltd	6.50%	15/01/28	USD	682	633,408	0.34
					3,023,810	1.62
KANADA						
MEGlobal Canada ULC	5.00%	18/05/25	USD	1,019	1,009,320	0.54
KAIMANINSELN						
Alibaba Group Holding Ltd	3.15%	09/02/51	USD	1,042	692,393	0.37
Alibaba Group Holding Ltd	3.25%	09/02/61	USD	1,127	712,997	0.38
China Evergrande Group †	11.50%	22/01/23 ^β	USD	3,191	47,865	0.03
DP World Crescent Ltd	5.50%	13/09/33	USD	960	984,533	0.53
IHS Holding Ltd	5.63%	29/11/26	USD	347	301,456	0.16
IHS Holding Ltd	6.25%	29/11/28	USD	680	549,100	0.30
Kaisa Group Holdings Ltd, FTB †	8.50%	30/06/22 ^β	USD	855	27,788	0.02
Kaisa Group Holdings Ltd, FTB †	11.95%	22/10/22 ^β	USD	855	27,788	0.02
Kaisa Group Holdings Ltd, FTB †	10.88%	23/07/23 ^β	USD	1,879	61,067	0.03
Kaisa Group Holdings Ltd †	9.75%	28/09/23 ^β	USD	226	7,345	0.00
Meituan	2.13%	28/10/25	USD	710	669,353	0.36
Melco Resorts Finance Ltd	5.75%	21/07/28	USD	1,354	1,254,354	0.67
Melco Resorts Finance Ltd	5.38%	04/12/29	USD	219	193,541	0.10
Saudi Electricity Sukuk Programme Co	5.68%	11/04/53	USD	730	748,478	0.40
Zhenro Properties Group Ltd †	9.15%	06/05/23 ^β	USD	280	2,800	0.00
					6,280,858	3.37
KOLUMBIEN						
Bancolombia SA, VRB	4.63%	18/12/29	USD	1,067	988,405	0.53
Ecopetrol SA	8.88%	13/01/33	USD	2,039	2,217,412	1.19
Empresas Publicas de Medellin ESP	8.38%	08/11/27	COP	5,070,000	1,120,288	0.60
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.25%	18/07/29	USD	508	434,782	0.23
					4,760,887	2.55
HONGKONG						
Airport Authority, VRB	2.10%	31/12/49†	USD	644	601,438	0.32
Airport Authority, VRB	2.40%	31/12/49†	USD	1,160	1,033,920	0.56

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
HONGKONG (Fortsetzung)						
Xiaomi Best Time International Ltd	2.88%	14/07/31	USD	202	167,342	0.09
					<hr/>	<hr/>
					1,802,700	0.97
INDIEN						
Adani Electricity Mumbai Ltd	3.87%	22/07/31	USD	680	529,231	0.28
Adani International Container Terminal Pvt Ltd	3.00%	16/02/31	USD	852	703,833	0.38
Shriram Finance Ltd	4.40%	13/03/24	USD	1,362	1,352,398	0.73
					<hr/>	<hr/>
					2,585,462	1.39
INSEL MAN						
AngloGold Ashanti Holdings Plc	3.38%	01/11/28	USD	1,120	1,013,107	0.54
Gohl Capital Ltd	4.25%	24/01/27	USD	1,753	1,684,524	0.91
					<hr/>	<hr/>
					2,697,631	1.45
ISRAEL						
Bank Hapoalim BM 144A, VRB	3.26%	21/01/32	USD	2,610	2,266,214	1.22
Bank Leumi Le-Israel BM 144A, VRB	7.13%	18/07/33	USD	578	570,775	0.31
Leviathan Bond Ltd 144A	6.50%	30/06/27	USD	1,487	1,405,008	0.75
Leviathan Bond Ltd 144A	6.75%	30/06/30	USD	152	139,602	0.07
					<hr/>	<hr/>
					4,381,599	2.35
JERSEY						
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd	2.94%	30/09/40	USD	3,401	2,816,637	1.51
West China Cement Ltd	4.95%	08/07/26	USD	85	62,143	0.03
					<hr/>	<hr/>
					2,878,780	1.54
KASACHSTAN						
KazMunayGas National Co JSC	5.75%	19/04/47	USD	1,845	1,624,753	0.87
					<hr/>	<hr/>
LUXEMBURG						
Aegea Finance Sarl	6.75%	20/05/29	USD	462	452,730	0.24
Chile Electricity Lux MPC Sarl	6.01%	20/01/33	USD	590	608,530	0.33
EIG Pearl Holdings Sarl	3.55%	31/08/36	USD	2,596	2,268,255	1.22
EIG Pearl Holdings Sarl	4.39%	30/11/46	USD	798	642,265	0.35
Greensaif Pipelines Bidco Sarl	6.13%	23/02/38	USD	523	547,515	0.29
Greensaif Pipelines Bidco Sarl	6.51%	23/02/42	USD	1,277	1,348,233	0.72
MHP Lux SA	6.95%	03/04/26	USD	852	664,560	0.36
Minerva Luxembourg SA	4.38%	18/03/31	USD	776	641,787	0.34
					<hr/>	<hr/>
					7,173,875	3.85
MALAYSIA						
GENM Capital Labuan Ltd	3.88%	19/04/31	USD	1,960	1,679,781	0.90
					<hr/>	<hr/>
MAURITIUS						
Axian Telecom	7.38%	16/02/27	USD	1,045	979,198	0.52
Greenko Power II Ltd	4.30%	13/12/28	USD	855	779,119	0.42
HTA Group Ltd/Mauritius	7.00%	18/12/25	USD	675	666,360	0.36
MTN Mauritius Investments Ltd	6.50%	13/10/26	USD	313	316,521	0.17
Network i2i Ltd, VRB	5.65%	31/12/49†	USD	1,360	1,341,937	0.72
					<hr/>	<hr/>
					4,083,135	2.19

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
MEXIKO						
America Movil SAB de CV	4.38%	22/04/49	USD	915	814,350	0.44
Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, VRB	8.38%	31/12/49†	USD	1,287	1,272,277	0.68
Braskem Idesa SAPI	7.45%	15/11/29	USD	602	374,564	0.20
Mexico City Airport Trust	5.50%	31/07/47	USD	1,021	883,349	0.47
					3,344,540	1.79
NIEDERLANDE						
Braskem Netherlands Finance BV	7.25%	13/02/33	USD	830	697,200	0.37
Metinvest BV	8.50%	23/04/26	USD	800	564,000	0.30
Metinvest BV	7.65%	01/10/27	USD	436	283,400	0.15
Metinvest BV	7.75%	17/10/29	USD	489	298,290	0.16
MV24 Capital BV	6.75%	01/06/34	USD	1,114	1,041,690	0.56
Prosus NV	3.06%	13/07/31	USD	206	166,667	0.09
Prosus NV	1.99%	13/07/33	EUR	899	736,245	0.40
Prosus NV	4.99%	19/01/52	USD	1,089	818,622	0.44
Royal Capital BV, VRB	5.00%	31/12/49†	USD	472	461,822	0.25
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	3.15%	01/10/26	USD	508	471,805	0.25
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	5.13%	09/05/29	USD	850	814,742	0.44
					6,354,483	3.41
NIGERIA						
United Bank for Africa Plc	6.75%	19/11/26	USD	395	365,375	0.20
OMAN						
Omanische internationale Staatsanleihe	6.75%	17/01/48	USD	660	692,278	0.37
SINGAPUR						
BOC Aviation Ltd	4.50%	23/05/28	USD	1,060	1,038,408	0.56
SÜDKOREA						
POSCO	5.88%	17/01/33	USD	200	209,635	0.11
Woori Bank	4.88%	26/01/28	USD	1,360	1,367,705	0.74
					1,577,340	0.85
ÜBERSTAATLICHE EMITTENTEN						
African Export-Import Bank	2.63%	17/05/26	USD	1,000	924,687	0.49
African Export-Import Bank	3.99%	21/09/29	USD	205	182,995	0.10
					1,107,682	0.59
THAILAND						
Bangkok Bank PCL/Hong Kong	4.30%	15/06/27	USD	1,230	1,206,741	0.65
Bangkok Bank PCL/Hong Kong, VRB	3.47%	23/09/36	USD	1,149	964,115	0.52
PTTEP Treasury Center Co Ltd	3.90%	06/12/59	USD	326	266,798	0.14
Thaioil Treasury Center Co Ltd	3.50%	17/10/49	USD	1,279	865,691	0.46
					3,303,345	1.77
TÜRKEI						
Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii AS	3.38%	29/06/28	USD	456	390,806	0.21
KOC Holding AS	6.50%	11/03/25	USD	1,065	1,062,670	0.57

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
TÜRKEI (Fortsetzung)						
Mersin Uluslararası Liman İsletmeciliği AS	8.25%	15/11/28	USD	830	869,342	0.47
Türk Telekomünikasyon AS	4.88%	19/06/24	USD	755	747,258	0.40
Turkcell İletişim Hizmetleri AS	5.75%	15/10/25	USD	322	317,772	0.17
Turkcell İletişim Hizmetleri AS	5.80%	11/04/28	USD	322	305,649	0.16
Türkische internationale Staatsanleihe	4.88%	16/04/43	USD	1,985	1,455,352	0.78
Türkiye İhracat Kredi Bankası AS	9.00%	28/01/27	USD	530	553,270	0.30
Türkiye Vakıflar Bankası Tao	9.00%	12/10/28	USD	493	518,574	0.28
Ziraat Katılım Varlık Kiralama AS	9.38%	12/11/26	USD	720	759,713	0.41
					6,980,406	3.75
UKRAINE						
Ukrainische internationale Staatsanleihe, FTB *	7.38%	25/09/34	USD	1,324	316,105	0.17
Ukrainische internationale Staatsanleihe, FRB*	7.75%	01/08/41	USD	1,410	634,909	0.34
VF Ukraine PAT via VFU Funding Plc	6.20%	11/02/25	USD	520	404,300	0.22
					1,355,314	0.73
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE						
Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	4.50%	14/09/27	USD	1,860	1,826,578	0.98
First Abu Dhabi Bank PJSC	5.13%	13/10/27	USD	1,725	1,738,746	0.93
First Abu Dhabi Bank PJSC, VRB	6.32%	04/04/34	USD	2,260	2,334,156	1.25
Nbk Tier 2 Ltd, VRB	2.50%	24/11/30	USD	2,000	1,875,938	1.01
Sweihan PV Power Co PJSC	3.63%	31/01/49	USD	2,482	2,039,461	1.10
					9,814,879	5.27
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Antofagasta Plc	5.63%	13/05/32	USD	1,070	1,068,495	0.57
Bidvest Group UK Plc	3.63%	23/09/26	USD	1,660	1,543,541	0.83
Standard Chartered Plc, VRB	6.30%	09/01/29	USD	1,558	1,599,879	0.86
Standard Chartered Plc, VRB	7.78%	16/11/25	USD	835	850,911	0.46
Standard Chartered Plc, VRB	4.64%	01/04/31	USD	366	345,310	0.18
Tullow Oil Plc	10.25%	15/05/26	USD	434	387,955	0.21
Vedanta Resources Finance II Plc	8.95%	11/03/25	USD	571	428,367	0.23
					6,224,458	3.34
VEREINIGTE STAATEN						
DAE Funding LLC	3.38%	20/03/28	USD	1,785	1,649,849	0.88
Hikma Finance USA LLC	3.25%	09/07/25	USD	1,084	1,039,962	0.56
Kosmos Energy Ltd	7.50%	01/03/28	USD	1,332	1,222,110	0.66
Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc	4.63%	06/04/31	USD	1,200	987,000	0.53
Stillwater Mining Co	4.00%	16/11/26	USD	2,207	1,964,230	1.05
Stillwater Mining Co	4.50%	16/11/29	USD	2,290	1,814,825	0.97
Schatzanweisung der Vereinigten Staaten	2.63%	31/12/23	USD	2,067	2,067,000	1.11
					10,744,976	5.76
ANLEIHEN INSGESAMT					100,133,700	53.73

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
STAMMAKTIE						
MEXIKO						
Urbi Desarrollos Urbanos SAB de CV			MXN	104	42,291	0.02
					42,291	0.02
STAMMAKTIE INSGESAMT						
KURZFRISTIGE ANLEIHEN						
KAIMANINSELN						
Zhenro Properties Group Ltd †	8.00%	06/03/23 ^β	USD	3,585	44,812	0.02
					44,812	0.02
KURZFRISTIGE ANLEIHEN INSGESAMT						
					100,220,803	53.77
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt						
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
ARGENTINIEN						
YPF SA	8.75%	04/04/24	USD	1,172	1,162,133	0.62
BRASILIE						
Banco do Brasil SA/Cayman	6.25%	18/04/30	USD	516	537,259	0.29
Samarco Mineracao SA, PIK	9.50%	30/06/31	USD	5,359	4,496,989	2.41
					5,034,248	2.70
BRITISCHE JUNGFERINSELN						
Studio City Finance Ltd	6.00%	15/07/25	USD	344	337,980	0.18
KANADA						
Canacol Energy Ltd	5.75%	24/11/28	USD	988	724,199	0.39
First Quantum Minerals Ltd	6.88%	15/10/27	USD	889	759,042	0.41
					1,483,241	0.80
KAIMANINSELN						
China Evergrande Group †	8.75%	28/06/25	USD	1,387	20,805	0.01
Kaisa Group Holdings Ltd, FTB †	10.88%	31/12/49†	USD	416	10,400	0.01
Kaisa Group Holdings Ltd, FTB †	11.50%	30/01/23 ^β	USD	473	15,372	0.01
Kaisa Group Holdings Ltd †	9.38%	30/06/24	USD	849	27,592	0.02
Melco Resorts Finance Ltd	5.63%	17/07/27	USD	444	418,817	0.23
MGM China Holdings Ltd	4.75%	01/02/27	USD	513	489,194	0.26
Oryx Funding Ltd	5.80%	03/02/31	USD	1,372	1,382,832	0.74
Sands China Ltd	4.30%	08/01/26	USD	810	780,891	0.42
Sands China Ltd	5.65%	08/08/28	USD	1,042	1,031,840	0.55
Seazen Group Ltd	4.45%	13/07/25	USD	537	171,840	0.09
Wynn Macau Ltd	5.13%	15/12/29	USD	1,206	1,072,775	0.58
Zhenro Properties Group Ltd †	8.30%	15/09/23 ^β	USD	336	3,360	0.00
Zhenro Properties Group Ltd †	6.63%	07/01/26	USD	541	5,410	0.00
Zhenro Properties Group Ltd †	6.70%	04/08/26	USD	4,428	44,280	0.02
					5,475,408	2.94
CHILE						
AES Andes SA, VRB	7.13%	26/03/79	USD	1,175	1,120,289	0.60
Agrosuper SA	4.60%	20/01/32	USD	690	596,660	0.32
CAP SA	3.90%	27/04/31	USD	835	643,063	0.34
Inversiones CMPC SA	3.00%	06/04/31	USD	603	514,434	0.28
Inversiones CMPC SA	6.13%	23/06/33	USD	820	851,519	0.46
Latam Airlines Group SA	13.38%	15/10/27	USD	59	65,850	0.03

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
CHILE (Fortsetzung)						
Telefonica Moviles Chile SA	3.54%	18/11/31	USD	1,322	982,824	0.53
					4,774,639	2.56
KOLUMBIEN						
Ecopetrol SA	8.63%	19/01/29	USD	1,030	1,101,617	0.59
Ecopetrol SA	5.88%	28/05/45	USD	1,453	1,146,417	0.62
Grupo Energia Bogota SA ESP	7.85%	09/11/33	USD	427	464,832	0.25
					2,712,866	1.46
GUATEMALA						
CT Trust	5.13%	03/02/32	USD	1,790	1,563,735	0.84
HONGKONG						
Huaxin Cement International Finance Co Ltd	2.25%	19/11/25	USD	982	904,280	0.48
INDIEN						
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd	4.38%	03/07/29	USD	476	411,368	0.22
INDONESIEN						
Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	3.40%	09/06/31	USD	1,140	988,772	0.53
ISRAEL						
Bank Leumi Le-Israel BM 144A	5.13%	27/07/27	USD	959	944,915	0.51
Bank Leumi Le-Israel BM 144A, VRB	3.28%	29/01/31	USD	375	339,785	0.18
Energiean Israel Finance Ltd 144A	8.50%	30/09/33	USD	597	570,788	0.30
Mizrahi Tefahot Bank Ltd 144A, VRB	3.08%	07/04/31	USD	2,830	2,511,625	1.35
					4,367,113	2.34
JERSEY						
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd	2.16%	31/03/34	USD	1,554	1,353,608	0.73
LUXEMBURG						
Aegea Finance Sarl	9.00%	20/01/31	USD	1,570	1,677,702	0.90
Millicom International Cellular SA	4.50%	27/04/31	USD	1,026	856,453	0.46
Minerva Luxembourg SA	8.88%	13/09/33	USD	670	711,949	0.38
					3,246,104	1.74
MEXIKO						
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand, VRB	7.53%	01/10/28	USD	411	430,913	0.23
BBVA Bancomer SA/Texas, VRB	5.88%	13/09/34	USD	2,015	1,889,133	1.01
BBVA Bancomer SA/Texas, VRB	8.45%	29/06/38	USD	780	829,647	0.44
Becle SAB de CV	2.50%	14/10/31	USD	1,061	854,271	0.46
Braskem Idesa SAPI	6.99%	20/02/32	USD	413	236,215	0.13
Cemex SAB de CV, VRB	9.13%	31/12/49†	USD	560	596,680	0.32
Cemex SAB de CV, VRB	5.13%	31/12/49†	USD	659	626,277	0.34
Electricidad Firme de Mexico Holdings SA de CV	4.90%	20/11/26	USD	530	477,228	0.26
Infraestructura Energetica Nova SAPI de CV	4.75%	15/01/51	USD	435	338,213	0.18

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
MEXIKO (Fortsetzung)						
Minera Mexico SA de CV	4.50%	26/01/50	USD	520	417,463	0.22
Petroleos Mexicanos	5.63%	23/01/46	USD	861	524,564	0.28
Petroleos Mexicanos	6.35%	12/02/48	USD	1,486	946,270	0.51
Sitios Latinoamerica SAB de CV	5.38%	04/04/32	USD	515	478,373	0.26
					8,645,247	4.64
MULTINATIONAL						
JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co. / JBS USA Finance, Inc.	5.75%	01/04/33	USD	763	756,503	0.41
NIEDERLANDE						
Braskem Netherlands Finance BV, VRB	8.50%	23/01/81	USD	497	434,875	0.23
Embraer Netherlands Finance BV	7.00%	28/07/30	USD	1,360	1,427,082	0.77
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	7.88%	15/09/29	USD	340	367,156	0.20
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	8.13%	15/09/31	USD	360	393,066	0.21
					2,622,179	1.41
PANAMA						
AES Panama Generation Holdings SRL	4.38%	31/05/30	USD	2,198	1,851,755	0.99
Banco General SA	4.13%	07/08/27	USD	663	622,391	0.34
					2,474,146	1.33
PARAGUAY						
Banco Continental SAECA	2.75%	10/12/25	USD	1,790	1,675,735	0.90
Telefonica Celular del Paraguay SA	5.88%	15/04/27	USD	1,247	1,222,241	0.65
					2,897,976	1.55
PERU						
Banco de Credito del Peru SA, VRB	3.13%	01/07/30	USD	2,446	2,317,940	1.24
Compania de Minas Buenaventura SAA	5.50%	23/07/26	USD	845	811,445	0.44
Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru	8.55%	18/09/33	USD	893	969,378	0.52
					4,098,763	2.20
PHILIPPINEN						
Philippinische internationale Staatsanleihe	5.50%	17/01/48	USD	510	537,731	0.29
SINGAPUR						
Continuum Energy Levanter Pte Ltd	4.50%	09/02/27	USD	985	931,897	0.50
Medco Maple Tree Pte Ltd	8.96%	27/04/29	USD	1,280	1,308,800	0.70
					2,240,697	1.20
SÜDKOREA						
Korea Electric Power Corp	5.38%	31/07/26	USD	2,600	2,628,054	1.41
LG Energy Solution Ltd	5.63%	25/09/26	USD	1,930	1,951,085	1.05
LG Energy Solution Ltd	5.75%	25/09/28	USD	1,190	1,223,386	0.65

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
SÜDKOREA (Fortsetzung)						
POSCO	5.75%	17/01/28	USD	430	440,677	0.24
					6,243,202	3.35
SPANIEN						
Al Candelaria Spain SA	5.75%	15/06/33	USD	939	728,054	0.39
TÜRKEI						
Limak Iskenderun Uluslararası Liman Isletmeciligi AS	9.50%	10/07/36	USD	1,460	1,337,295	0.72
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Avianca Midco 2 Plc 144A	9.00%	01/12/28	USD	1,034	909,549	0.49
Endeavour Mining Plc	5.00%	14/10/26	USD	1,020	945,731	0.51
Fresnillo Plc	4.25%	02/10/50	USD	769	587,924	0.31
					2,443,204	1.31
VEREINIGTE STAATEN						
Azul Secured Finance LLP	11.93%	28/08/28	USD	610	632,398	0.34
BOC Aviation USA Corp	4.88%	03/05/33	USD	390	381,541	0.20
SierraCol Energy Andina LLC	6.00%	15/06/28	USD	622	521,062	0.28
					1,535,001	0.82
ANLEIHEN INSGESAMT					70,375,493	37.76
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt					70,375,493	37.76
Sonstige Wertpapiere						
ANLEIHEN						
BERMUDA						
Digicel Group Holdings Ltd †	0.00%	31/12/30	USD	262	144,246	0.08
Digicel Group Holdings Ltd †	0.00%	31/12/30	USD	591	44,311	0.02
Digicel Group Holdings Ltd †	0.00%	31/12/30	USD	14	7,951	0.01
Digicel Group Holdings Ltd †	0.00%	31/12/30	USD	656	19,666	0.01
					216,174	0.12
MULTINATIONAL						
Digicel International Finance Ltd/Digicel international Holdings Ltd	8.75%	25/05/24	USD	1,300	1,218,607	0.65
ANLEIHEN INSGESAMT					1,434,781	0.77
STAMMAKTIE						
LUXEMBURG						
Drillco Holding Lux SA			USD	12	305,425	0.16
Drillco Holding Lux SA			USD	1	33,925	0.02
					339,350	0.18
STAMMAKTIE INSGESAMT					339,350	0.18

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Sonstige Wertpapiere (Fortsetzung)						
OPTIONSSCHEINE						
MEXIKO						
Urbi Warrant			MXN	1,184	0	0.00
					0	0.00
OPTIONSSCHEINE INSGESAMT					0	0.00
Sonstige Wertpapiere insgesamt					1,774,131	0.95
Anlagen insgesamt <i>(Kosten USD 194,364,368)</i>					172,370,427	92.48
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					14,014,455	7.52
Nettovermögen insgesamt					186,384,882	100.00

Glossar:

FTB - Flat Trading Bond (pauschal gehandelte Anleihe)

FRB - Floating Rate Bond (Anleihe mit variablem Zins)

PIK - Payment-in-Kind (Sachleistung)

S/U - Step Up Bond

VRB - Variable Rate Bond (variabel verzinsliche Anleihe)

± notleidendes Wertpapier

† Unbefristete Laufzeit

β Die Anlage stellt ein offenstehendes Geschäft nach dem Fälligkeitsdatum dar

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.

Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay Global Convertible Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
BELGIEN						
Groupe Bruxelles Lambert NV	2.13%	29/11/25	EUR	100	107,536	1.01
Umicore SA	0.00%	23/06/25	EUR	200	207,070	1.93
					314,606	2.94
BRITISCHE JUNGFERNINSELN						
ANLLIAN Capital Ltd	0.00%	05/02/25	EUR	100	109,581	1.02
KAIMANINSELN						
NIO Inc	0.50%	01/02/27	USD	65	59,964	0.56
XD Inc	1.25%	12/04/26	USD	200	193,282	1.80
					253,246	2.36
FRANKREICH						
Accor SA ^Ω	0.70%	07/12/27	EUR	61	67,238	0.63
Atos SE	0.00%	06/11/24	EUR	100	88,761	0.83
Edenred SE	0.00%	06/09/24	EUR	92	101,422	0.94
					257,421	2.40
DEUTSCHLAND						
Deutsche Lufthansa AG	2.00%	17/11/25	EUR	100	118,807	1.11
RAG-Stiftung	1.88%	16/11/29	EUR	100	113,638	1.06
Rheinmetall AG	1.88%	07/02/28	EUR	100	123,213	1.15
					355,658	3.32
HONGKONG						
Xiaomi Best Time International Ltd	0.00%	17/12/27	USD	200	179,000	1.67
ITALIEN						
Prysmian SpA	0.00%	02/02/26	EUR	100	122,368	1.14
Saipem SpA	2.88%	11/09/29	EUR	100	118,291	1.11
					240,659	2.25
JAPAN						
ANA Holdings Inc	0.00%	10/12/31	JPY	10,000	79,896	0.75
JFE Holdings Inc	0.00%	28/09/28	JPY	10,000	74,194	0.69
Nippon Steel Corp	0.00%	04/10/24	JPY	10,000	95,528	0.89
SBI Holdings Inc	0.00%	25/07/25	JPY	10,000	83,070	0.77
					332,688	3.10
LUXEMBURG						
Lagfin SCA	3.50%	08/06/28	EUR	100	108,668	1.01
MAURITIUS						
HTA Group Ltd/Mauritius	2.88%	18/03/27	USD	200	174,312	1.63
MEXIKO						
Fomento Economico Mexicano SAB de CV	2.63%	24/02/26	EUR	100	110,618	1.03
NIEDERLANDE						
America Movil BV	0.00%	02/03/24	EUR	100	111,660	1.04
Encavis Finance BV, VRB	1.88%	31/12/49†	EUR	100	101,490	0.95

BlueBay Funds – BlueBay Global Convertible Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
NIEDERLANDE (Fortsetzung)						
QIAGEN NV	1.00%	13/11/24	USD	200	205,688	1.92
					418,838	3.91
PANAMA						
Carnival Corp	5.75%	01/12/27	USD	26	42,795	0.40
SÜDKOREA						
LG Chem Ltd	1.25%	18/07/28	USD	200	192,100	1.79
SK Hynix Inc	1.75%	11/04/30	USD	200	278,250	2.60
					470,350	4.39
SPANIEN						
Cellnex Telecom SA	0.50%	05/07/28	EUR	200	235,921	2.20
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
JET2 Plc	1.63%	10/06/26	GBP	100	123,694	1.15
WH Smith Plc	1.63%	07/05/26	GBP	100	116,223	1.09
					239,917	2.24
VIETNAM						
Vingroup JSC	10.00%	13/11/28	USD	200	200,233	1.87
					4,044,511	37.74
ANLEIHEN INSGESAMT						
STAMMAKTIEN						
AUSTRALIEN						
Paladin Energy Ltd			AUD	46	31,220	0.29
FRANKREICH						
TotalEnergies SE			EUR	1	38,446	0.36
ITALIEN						
ENI SpA			EUR	3	54,660	0.51
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
BP Plc			GBP	4	26,718	0.25
					151,044	1.41
STAMMAKTIEN INSGESAMT						
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt					4,195,555	39.15
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
KANADA						
SSR Mining Inc	2.50%	01/04/39	USD	64	61,691	0.58
KAIMANINSELN						
H World Group Ltd	3.00%	01/05/26	USD	81	87,312	0.82
Meituan	0.00%	27/04/28	USD	200	173,374	1.62
Seagate HDD Cayman 144A	3.50%	01/06/28	USD	132	158,990	1.48
Tequ Mayflower Ltd	0.00%	02/03/26	USD	200	146,000	1.36

BlueBay Funds – BlueBay Global Convertible Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
KAIMANINSELN (Fortsetzung)						
ZTO Express Cayman Inc	1.50%	01/09/27	USD	106	101,232	0.94
					666,908	6.22
DÄNEMARK						
Ascendis Pharma	2.25%	01/04/28	USD	33	33,977	0.32
ISRAEL						
CyberArk Software Ltd	0.00%	15/11/24	USD	40	56,834	0.53
VEREINIGTE STAATEN						
Airbnb Inc	0.00%	15/03/26	USD	117	105,460	0.98
Akamai Technologies Inc	0.13%	01/05/25	USD	185	236,130	2.20
Akamai Technologies Inc 144A	1.13%	15/02/29	USD	45	48,911	0.46
Alnylam Pharmaceuticals Inc	1.00%	15/09/27	USD	34	33,683	0.31
American Airlines Group Inc	6.50%	01/07/25	USD	104	115,872	1.08
American Water Capital Corp 144A	3.63%	15/06/26	USD	165	165,083	1.54
Bentley Systems Inc	0.13%	15/01/26	USD	77	76,581	0.71
Bloom Energy Corp 144A	3.00%	01/06/28	USD	61	65,871	0.61
Booking Holdings Inc	0.75%	01/05/25	USD	11	20,725	0.19
Bridgebio Pharma Inc	2.50%	15/03/27	USD	23	27,916	0.26
CONMED Corp	2.25%	15/06/27	USD	55	55,277	0.52
Cytokinetics Inc	3.50%	01/07/27	USD	39	69,321	0.65
Datadog Inc	0.13%	15/06/25	USD	69	97,058	0.91
Dexcom Inc 144A	0.38%	15/05/28	USD	179	183,890	1.72
Dropbox Inc	0.00%	01/03/26	USD	115	113,143	1.06
EQT Corp	1.75%	01/05/26	USD	6	16,018	0.15
Etsy Inc	0.13%	01/10/26	USD	74	85,381	0.80
Exact Sciences Corp	0.38%	15/03/27	USD	271	264,024	2.46
Ford Motor Co	0.00%	15/03/26	USD	238	237,888	2.22
Halozyme Therapeutics Inc	1.00%	15/08/28	USD	64	59,763	0.56
Insmed Inc	0.75%	01/06/28	USD	40	45,988	0.43
Insulet Corp	0.38%	01/09/26	USD	55	63,444	0.59
Ionis Pharmaceuticals Inc	0.00%	01/04/26	USD	57	60,259	0.56
Lantheus Holdings Inc	2.63%	15/12/27	USD	39	43,804	0.41
Liberty Media Corp 144A	3.75%	15/03/28	USD	37	44,435	0.41
Live Nation Entertainment Inc 144A	3.13%	15/01/29	USD	150	170,039	1.59
MACOM Technology Solutions Holdings Inc	0.25%	15/03/26	USD	47	58,216	0.54
Marriott Vacations Worldwide Corp	0.00%	15/01/26	USD	98	86,857	0.81
Merit Medical Systems Inc 144A	3.00%	01/02/29	USD	32	35,496	0.33
Middleby Corp	1.00%	01/09/25	USD	17	20,814	0.19
MP Materials Corp 144A	0.25%	01/04/26	USD	265	234,757	2.19
Northern Oil & Gas Inc	3.63%	15/04/29	USD	63	74,597	0.70
Nutanix Inc	0.25%	01/10/27	USD	85	88,786	0.83
ON Semiconductor Corp 144A	0.50%	01/03/29	USD	143	151,011	1.41
Ormat Technologies Inc	2.50%	15/07/27	USD	29	30,012	0.28
Pebblebrook Hotel Trust	1.75%	15/12/26	USD	123	110,269	1.03
Rivian Automotive Inc 144A	4.63%	15/03/29	USD	231	323,788	3.02
Shift4 Payments Inc	0.00%	15/12/25	USD	68	75,915	0.71
Shockwave Medical Inc 144A	1.00%	15/08/28	USD	65	63,487	0.59
Southwest Airlines Co	1.25%	01/05/25	USD	108	109,413	1.02
Tetra Tech Inc 144A	2.25%	15/08/28	USD	62	64,959	0.61
Tyler Technologies Inc	0.25%	15/03/26	USD	41	41,559	0.39
Uber Technologies Inc	0.00%	15/12/25	USD	78	80,161	0.75
Ventas Realty LP 144A	3.75%	01/06/26	USD	96	101,586	0.95
Welltower OP LLC 144A	2.75%	15/05/28	USD	71	78,471	0.73
Western Digital Corp 144A	3.00%	15/11/28	USD	122	149,528	1.40
Workiva Inc 144A	1.25%	15/08/28	USD	48	48,979	0.46
Zillow Group Inc	0.75%	01/09/24	USD	85	115,084	1.07

BlueBay Funds – BlueBay Global Convertible Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)						
Zscaler Inc	0.13%	01/07/25	USD	87	132,272	1.23
					4,781,981	44.62
ANLEIHEN INSGESAMT					5,601,391	52.27
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt					5,601,391	52.27
Sonstige Wertpapiere						
ANLEIHEN						
JAPAN						
Daifuku Co Ltd	0.00%	14/09/28	JPY	10,000	76,305	0.71
					76,305	0.71
ANLEIHEN INSGESAMT					76,305	0.71
Sonstige Wertpapiere insgesamt					76,305	0.71
Anlagen insgesamt (Kosten USD 9,418,548)					9,873,251	92.13
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					843,163	7.87
Nettovermögen insgesamt					10,716,414	100.00

Glossar:

VRB - Variable Rate Bond (variabel verzinsliche Anleihe)

Ω Wertpapier mit „Dirty Price“ bewertet

† Unbefristete Laufzeit

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.
Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.
Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
ANGOLA						
Angolanische internationale Staatsanleihe	8.75%	14/04/32	USD	6,625	5,871,406	1.23
ARGENTINIEN						
Argentinische internationale Staatsanleihe, FTB [±]	0.00%	15/12/35	EUR	36,000	2,077,847	0.44
Argentinische internationale Staatsanleihe, FTB [±]	0.00%	15/12/35	USD	100,058	4,002,320	0.84
Argentinische internationale Staatsanleihe, S/U	3.63%	09/07/46	USD	23,566	8,164,087	1.71
					14,244,254	2.99
KAIMANINSELN						
Gaci First Investment Co	5.13%	14/02/53	USD	9,740	8,837,528	1.86
Kaisa Group Holdings Ltd, FTB [±]	8.50%	30/06/22 ^B	USD	7,561	245,732	0.05
Kaisa Group Holdings Ltd, FTB [±]	11.95%	22/10/22 ^B	USD	3,878	126,035	0.03
Saudi Electricity Sukuk Programme Co	5.68%	11/04/53	USD	4,665	4,783,083	1.00
					13,992,378	2.94
CHILE						
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 144A	5.30%	01/11/37	CLP	5,770,000	6,536,085	1.37
KOLUMBIEN						
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	8.75%	14/11/53	USD	6,200	7,140,656	1.50
Kolumbianische TES	2.25%	18/04/29	COP	52,228,495	12,577,487	2.64
Kolumbianische TES	7.00%	30/06/32	COP	64,633,200	13,989,067	2.94
Kolumbianische TES	13.25%	09/02/33	COP	21,777,500	6,696,188	1.40
Kolumbianische TES	7.25%	26/10/50	COP	40,205,600	7,564,444	1.59
					47,967,842	10.07
COSTA RICA						
Costa-ricanische internationale Staatsanleihe	7.30%	13/11/54	USD	6,940	7,550,789	1.58
DOMINIKANISCHE REPUBLIK						
Dominikanische internationale Staatsanleihe	11.25%	15/09/35	DOP	394,250	7,346,726	1.54
ÄGYPTEN						
Ägyptische internationale Staatsanleihe	5.75%	29/05/24	USD	2,638	2,584,828	0.54
Ägyptische internationale Staatsanleihe	6.38%	11/04/31	EUR	12,957	9,227,380	1.94
Ägyptische internationale Staatsanleihe	7.63%	29/05/32	USD	5,630	3,927,804	0.82
Ägyptische internationale Staatsanleihe	7.30%	30/09/33	USD	6,133	4,070,779	0.86
Ägyptische internationale Staatsanleihe	7.50%	16/02/61	USD	9,175	5,384,578	1.13
					25,195,369	5.29

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
GHANA						
Ghanaische internationale Staatsanleihe	10.75%	14/10/30	USD	18,836	11,937,315	2.50
INDONESIEN						
Indonesische Schatzanweisung	7.13%	15/06/38	IDR	290,801,000	19,802,874	4.16
MEXIKO						
America Movil SAB de CV	9.50%	27/01/31	MXN	176,800	10,137,198	2.13
Banco Actinver SA	9.50%	18/12/32	MXN	222,969	8,035,531	1.69
Mexikanische internationale Staatsanleihe	6.34%	04/05/53	USD	9,200	9,399,813	1.97
					27,572,542	5.79
PAKISTAN						
Pakistanische internationale Staatsanleihe	8.25%	15/04/24	USD	5,301	5,043,902	1.06
Pakistanische internationale Staatsanleihe	6.00%	08/04/26	USD	4,219	3,001,423	0.63
Pakistanische internationale Staatsanleihe	7.88%	31/03/36	USD	617	392,566	0.08
					8,437,891	1.77
POLEN						
Bank Gospodarstwa Krajowego	5.38%	22/05/33	USD	5,820	5,914,284	1.24
Polnische internationale Staatsanleihe	5.50%	04/04/53	USD	6,908	7,228,462	1.52
					13,142,746	2.76
RUMÄNIEN						
Rumänische Staatsanleihe	4.25%	28/04/36	RON	57,520	10,609,193	2.22
Rumänische internationale Staatsanleihe	7.63%	17/01/53	USD	15,996	17,961,909	3.77
					28,571,102	5.99
SÜDAFRIKA						
Eskom Holdings SOC Ltd	8.50%	25/04/42	ZAR	44,000	1,611,982	0.34
TUNESIEN						
Tunesische Republik	5.63%	17/02/24	EUR	4,736	5,071,587	1.06
Tunesische Republik	5.75%	30/01/25	USD	9,206	7,569,058	1.59
					12,640,645	2.65
TÜRKEI						
Istanbul Metropolitan Municipality	10.50%	06/12/28	USD	4,870	5,187,037	1.09
Türkische Staatsanleihe	0.00%	19/07/28	TRY	24,832	855,508	0.18
					6,042,545	1.27
UKRAINE						
Ukrainische internationale Staatsanleihe, FTB *	7.38%	25/09/34	USD	20,682	4,937,827	1.03
Ukrainische internationale Staatsanleihe, FRB ‡	7.75%	01/08/41	USD	28,127	12,665,307	2.66
					17,603,134	3.69

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTE STAATEN						
Schatzanweisung der Vereinigten Staaten	4.50%	30/11/24	USD	22,467	22,385,490	4.70
URUGUAY						
Uruguayische internationale Staatsanleihe	9.75%	20/07/33	UYU	146,164	3,800,998	0.80
USBKISTAN						
Usbekische internationale Staatsanleihe	7.85%	12/10/28	USD	6,600	6,911,438	1.45
Usbekische internationale Staatsanleihe	3.90%	19/10/31	USD	8,500	7,153,281	1.50
					14,064,719	2.95
VENEZUELA						
Petroleos de Venezuela SA †	8.50%	27/10/20 ^β	USD	17,133	13,636,399	2.86
SAMBIA						
Sambische internationale Staatsanleihe, FTB †	5.38%	20/09/22 ^β	USD	4,164	2,341,459	0.49
Sambische internationale Staatsanleihe, FTB †	8.97%	30/07/27	USD	1,495	930,871	0.20
					3,272,330	0.69
ANLEIHEN INSGESAMT					333,227,561	69.93
KURZFRISTIGE ANLEIHEN						
KAIMANINSELN						
Zhenro Properties Group Ltd †	8.00%	06/03/23 ^β	USD	10,908	136,350	0.03
KURZFRISTIGE ANLEIHEN INSGESAMT					136,350	0.03
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt					333,363,911	69.96
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
ARGENTINIEN						
Provincia de Buenos Aires, S/U	6.38%	01/09/37	USD	43,711	16,916,131	3.55
YPF SA	8.75%	04/04/24	USD	5,189	5,146,874	1.08
YPF SA	8.50%	23/03/25	USD	2,305	2,227,684	0.47
					24,290,689	5.10
BRASILIEN						
Samarco Mineracao SA, PIK	9.50%	30/06/31	USD	11,017	9,245,052	1.94
KAIMANINSELN						
Kaisa Group Holdings Ltd †	11.25%	16/04/25	USD	10,381	337,382	0.07
Zhenro Properties Group Ltd †	6.63%	07/01/26	USD	2,123	21,230	0.00
					358,612	0.07
KOLUMBIEN						
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	8.00%	14/11/35	USD	5,220	5,719,978	1.20

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
KOLUMBIEN (Fortsetzung)						
Ecopetrol SA	8.63%	19/01/29	USD	11,500	12,299,610	2.58
					18,019,588	3.78
MEXIKO						
BBVA Bancomer SA/Texas, VRB	8.45%	29/06/38	USD	5,000	5,318,250	1.12
PERU						
Peruanische internationale Staatsanleihe	7.30%	12/08/33	PEN	41,311	11,688,784	2.45
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
WE Soda Investments Holding Plc	9.50%	06/10/28	USD	4,900	5,087,425	1.07
VENEZUELA						
Venezolanische internationale Staatsanleihe †	9.25%	15/09/27	USD	6,350	1,231,305	0.26
ANLEIHEN INSGESAMT					75,239,705	15.79
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt					75,239,705	15.79
Sonstige Wertpapiere						
ANLEIHEN						
PERU						
Sites Del Peru SAC	9.13%	21/09/33	PEN	27,085	7,455,654	1.56
ANLEIHEN INSGESAMT					7,455,654	1.56
Sonstige Wertpapiere insgesamt					7,455,654	1.56
Anlagen insgesamt (Kosten USD 429,549,356)					416,059,270	87.31
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					60,482,607	12.69
Nettovermögen insgesamt					476,541,877	100.00

Glossar:

FTB - Flat Trading Bond (pauschal gehandelte Anleihe)

FRB - Floating Rate Bond (Anleihe mit variablem Zins)

PIK - Payment-in-Kind (Sachleistung)

S/U - Step Up Bond

VRB - Variable Rate Bond (variabel verzinsliche Anleihe)

± notleidendes Wertpapier

β Die Anlage stellt ein offenstehendes Geschäft nach dem Fälligkeitsdatum dar

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.

Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
ÖSTERREICH						
Österreichische Staatsanleihe 144A	0.75%	20/02/28	EUR	61,722	58,008,821	1.58
Österreichische Staatsanleihe 144A	0.50%	20/02/29	EUR	23,538	21,497,730	0.59
Österreichische Staatsanleihe 144A	2.90%	23/05/29	EUR	16,440	16,948,011	0.46
Österreichische Staatsanleihe 144A	2.90%	20/02/33	EUR	34,890	35,789,378	0.98
Österreichische Staatsanleihe 144A	3.15%	20/10/53	EUR	16,100	16,857,386	0.46
					<u>149,101,326</u>	<u>4.07</u>
BELGIEN						
Belgische Staatsanleihe 144A	0.00%	22/10/31	EUR	22,300	18,445,417	0.50
Belgische Staatsanleihe 144A	0.35%	22/06/32	EUR	68,046	56,884,062	1.55
Belgische Staatsanleihe 144A	3.00%	22/06/33	EUR	38,157	39,401,978	1.08
Belgische Staatsanleihe 144A	0.40%	22/06/40	EUR	38,300	25,546,983	0.70
Belgische Staatsanleihe 144A	1.60%	22/06/47	EUR	4,017	3,024,997	0.08
Belgische Staatsanleihe 144A	1.70%	22/06/50	EUR	14,653	10,927,376	0.30
					<u>154,230,813</u>	<u>4.21</u>
ESTLAND						
Estnische internationale Staatsanleihe	0.13%	10/06/30	EUR	14,959	12,461,016	0.34
Estnische internationale Staatsanleihe	4.00%	12/10/32	EUR	60,954	65,706,941	1.79
					<u>78,167,957</u>	<u>2.13</u>
FRANKREICH						
Französische Staatsanleihe OAT	1.00%	25/11/25	EUR	75,904	73,897,537	2.02
Französische Staatsanleihe OAT	0.25%	25/11/26	EUR	44,744	42,261,344	1.15
Französische Staatsanleihe OAT	1.00%	25/05/27	EUR	31,000	29,757,165	0.81
Französische Staatsanleihe OAT	0.75%	25/02/28	EUR	65,587	61,805,814	1.69
Französische Staatsanleihe OAT	1.50%	25/05/31	EUR	6,302	5,949,671	0.16
Französische Staatsanleihe OAT	3.00%	25/05/33	EUR	206,239	214,551,845	5.85
Französische Staatsanleihe OAT 144A	0.50%	25/05/40	EUR	11,103	7,690,988	0.21
Französische Staatsanleihe OAT 144A	2.00%	25/05/48	EUR	64,472	53,347,154	1.46
Französische Staatsanleihe OAT 144A	1.50%	25/05/50	EUR	76,087	55,295,849	1.51
Französische Staatsanleihe OAT 144A	1.75%	25/05/66	EUR	9,251	6,625,199	0.18
Französische Staatsanleihe OAT 144A	0.50%	25/05/72	EUR	6,700	2,811,289	0.08
					<u>553,993,855</u>	<u>15.12</u>

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
DEUTSCHLAND						
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.00%	15/02/32	EUR	76,853	65,751,107	1.80
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	1.70%	15/08/32	EUR	5,138	5,030,256	0.14
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	2.30%	15/02/33	EUR	60,867	62,450,642	1.70
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	4.75%	04/07/40	EUR	26,732	35,797,949	0.98
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	1.25%	15/08/48	EUR	26,787	21,770,498	0.59
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.00%	15/08/52	EUR	54,400	29,026,856	0.79
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	1.80%	15/08/53	EUR	16,350	14,759,283	0.40
Bundesschatzanweisungen	0.20%	14/06/24	EUR	99,040	97,583,645	2.66
Bundesschatzanweisungen	2.80%	12/06/25	EUR	92,218	92,393,930	2.52
					424,564,166	11.58
GRIECHENLAND						
Griechische Staatsanleihe 144A	4.25%	15/06/33	EUR	15,852	17,387,408	0.47
Griechische Staatsanleihe 144A	4.38%	18/07/38	EUR	51,166	56,256,647	1.54
					73,644,055	2.01
ISLAND						
Iceland Rikisbref	4.50%	17/02/42	ISK	4,032,528	21,265,520	0.58
IRLAND						
Irische Staatsanleihe	3.40%	18/03/24	EUR	16,000	15,991,665	0.44
Irische Staatsanleihe	2.40%	15/05/30	EUR	17,490	17,675,379	0.48
Irische Staatsanleihe	1.35%	18/03/31	EUR	16,161	15,201,137	0.41
Irische Staatsanleihe	0.00%	18/10/31	EUR	9,870	8,282,212	0.23
Irische Staatsanleihe	2.00%	18/02/45	EUR	7,907	6,842,532	0.19
					63,992,925	1.75
ISRAEL						
Israelische internationale Staatsanleihe	0.63%	18/01/32	EUR	61,013	47,211,424	1.29
ITALIEN						
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	1.25%	01/12/26	EUR	53,060	50,835,853	1.39
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	3.00%	01/08/29	EUR	4,640	4,622,501	0.12
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A	1.45%	01/03/36	EUR	23,153	17,819,810	0.49
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A	4.75%	01/09/44	EUR	36,931	39,723,096	1.08
					113,001,260	3.08
LETTLAND						
Lettische internationale Staatsanleihe	3.88%	25/03/27	EUR	21,991	22,662,302	0.62
Lettische internationale Staatsanleihe	3.50%	17/01/28	EUR	63,063	64,484,464	1.76

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
LETTLAND (Fortsetzung)						
Lettische internationale Staatsanleihe	3.88%	12/07/33	EUR	25,900	27,156,735	0.74
					114,303,501	3.12
LITAUEN						
Litauische internationale Staatsanleihe	3.88%	14/06/33	EUR	45,520	47,811,383	1.30
MEXIKO						
Mexikanische internationale Staatsanleihe	4.00%	15/03/15 [^]	EUR	86,223	66,889,792	1.83
NIEDERLANDE						
Niederländische Staatsanleihe 144A	0.50%	15/07/32	EUR	65,504	56,554,828	1.54
RUMÄNIEN						
Rumänische internationale Staatsanleihe	5.50%	18/09/28	EUR	30,670	31,584,400	0.86
Rumänische internationale Staatsanleihe	3.62%	26/05/30	EUR	1,333	1,227,928	0.03
Rumänische internationale Staatsanleihe	1.75%	13/07/30	EUR	7,012	5,686,823	0.15
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.12%	16/07/31	EUR	25,052	20,023,365	0.55
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.00%	28/01/32	EUR	5,916	4,591,269	0.13
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.00%	14/04/33	EUR	34,008	25,529,624	0.70
Rumänische internationale Staatsanleihe	3.88%	29/10/35	EUR	5,888	5,030,429	0.14
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.63%	02/12/40	EUR	59,696	40,300,605	1.10
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.75%	14/04/41	EUR	33,720	22,717,502	0.62
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.88%	13/04/42	EUR	18,464	12,540,082	0.34
Rumänische internationale Staatsanleihe	4.63%	03/04/49	EUR	13,354	11,247,622	0.31
Rumänische internationale Staatsanleihe	3.38%	28/01/50	EUR	16,857	11,529,270	0.31
					192,008,919	5.24
SLOWENIEN						
Slowenische Staatsanleihe	0.00%	12/02/31	EUR	14,100	11,586,077	0.32
Slowenische internationale Staatsanleihe	5.00%	19/09/33	USD	26,320	24,278,654	0.66
					35,864,731	0.98
SPANIEN						
Spanische Staatsanleihe	0.00%	31/05/25	EUR	30,306	29,084,316	0.79
Spanische Staatsanleihe	0.00%	31/01/27	EUR	158,469	146,689,167	4.00
Spanische Staatsanleihe	0.00%	31/01/28	EUR	14,624	13,212,122	0.36
Spanische Staatsanleihe 144A	3.80%	30/04/24	EUR	135,400	135,417,525	3.69
Spanische Staatsanleihe 144A	1.60%	30/04/25	EUR	32,965	32,384,369	0.88
Spanische Staatsanleihe 144A	1.30%	31/10/26	EUR	23,700	22,910,374	0.63
Spanische Staatsanleihe 144A	1.40%	30/04/28	EUR	24,100	23,000,473	0.63

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
SPANIEN (Fortsetzung)						
Spanische Staatsanleihe 144A	1.95%	30/07/30	EUR	2,560	2,448,960	0.07
Spanische Staatsanleihe 144A	0.70%	30/04/32	EUR	157,646	133,031,743	3.63
Spanische Staatsanleihe 144A	2.55%	31/10/32	EUR	20,146	19,643,100	0.54
Spanische Staatsanleihe 144A	2.35%	30/07/33	EUR	68,750	65,380,034	1.78
Spanische Staatsanleihe 144A	1.00%	30/07/42	EUR	20,594	13,786,098	0.38
Spanische Staatsanleihe 144A	2.90%	31/10/46	EUR	10,173	9,200,951	0.25
Spanische Staatsanleihe 144A	2.70%	31/10/48	EUR	4,149	3,571,671	0.10
Spanische Staatsanleihe 144A	1.00%	31/10/50	EUR	49,284	27,780,997	0.76
					677,541,900	18.49
ANLEIHEN INSGESAMT					2,870,148,355	78.32
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt					2,870,148,355	78.32
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
FRANKREICH						
Französische Staatsanleihe OAT	2.75%	25/10/27	EUR	27,200	27,706,469	0.76
Französische Staatsanleihe OAT	2.50%	25/05/30	EUR	107,984	109,358,005	2.98
					137,064,474	3.74
ITALIEN						
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	1.45%	15/05/25	EUR	147,139	144,046,407	3.93
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	2.05%	01/08/27	EUR	19,600	19,093,163	0.52
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	2.00%	01/02/28	EUR	116,069	112,222,608	3.06
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A	0.60%	01/08/31	EUR	93,465	76,380,846	2.08
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A	0.95%	01/12/31	EUR	18,870	15,694,084	0.43
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A	2.45%	01/09/33	EUR	46,500	42,213,050	1.15
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A	2.95%	01/09/38	EUR	26,798	23,756,112	0.65
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A	3.10%	01/03/40	EUR	4,462	3,952,152	0.11
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A	5.00%	01/09/40	EUR	6,060	6,695,529	0.18
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A	3.85%	01/09/49	EUR	10,283	9,714,827	0.27
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A	2.15%	01/09/52	EUR	30,870	20,544,883	0.56
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A	2.80%	01/03/67	EUR	21,802	15,967,394	0.44
					490,281,055	13.38
MEXIKO						
Mexikanische internationale Staatsanleihe	2.13%	25/10/51	EUR	18,900	11,490,136	0.31
RUMÄNIEN						
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.88%	26/05/28	EUR	9,624	9,011,288	0.24
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.50%	08/02/30	EUR	2,057	1,786,896	0.05

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
RUMÄNIEN (Fortsetzung)						
Rumänische internationale Staatsanleihe	3.38%	08/02/38	EUR	4,578	3,590,590	0.10
					14,388,774	0.39
ANLEIHEN INSGESAMT					653,224,439	17.82
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt					653,224,439	17.82
Anlagen insgesamt <i>(Kosten EUR 3,731,158,964)</i>					3,523,372,794	96.14
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					141,389,202	3.86
Nettovermögen insgesamt					3,664,761,996	100.00

^ Fälligkeitsdatum ist der 15. März 2115

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.
Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.
Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
ÖSTERREICH						
Österreichische Staatsanleihe 144A	0.75%	20/02/28	EUR	36,318	34,133,119	1.42
Österreichische Staatsanleihe 144A	0.50%	20/02/29	EUR	1,821	1,663,156	0.07
Österreichische Staatsanleihe 144A	2.90%	23/05/29	EUR	6,138	6,327,670	0.26
Österreichische Staatsanleihe 144A	2.90%	20/02/33	EUR	11,350	11,642,575	0.48
Österreichische Staatsanleihe 144A	3.15%	20/10/53	EUR	6,100	6,386,960	0.27
					<u>60,153,480</u>	<u>2.50</u>
BELGIEN						
Belgische Staatsanleihe 144A	0.00%	22/10/31	EUR	23,390	19,347,009	0.81
Belgische Staatsanleihe 144A	0.35%	22/06/32	EUR	27,670	23,130,740	0.96
Belgische Staatsanleihe 144A	3.00%	22/06/33	EUR	21,712	22,420,414	0.93
Belgische Staatsanleihe 144A	1.70%	22/06/50	EUR	4,765	3,553,260	0.15
					<u>68,451,423</u>	<u>2.85</u>
KANADA						
Fairfax Financial Holdings Ltd	2.75%	29/03/28	EUR	12,705	12,131,082	0.50
DÄNEMARK						
TDC Net A/S	6.50%	01/06/31	EUR	4,644	4,922,319	0.20
ESTLAND						
Estnische internationale Staatsanleihe	0.13%	10/06/30	EUR	5,432	4,524,917	0.19
Estnische internationale Staatsanleihe	4.00%	12/10/32	EUR	20,389	21,978,850	0.91
					<u>26,503,767</u>	<u>1.10</u>
FRANKREICH						
AXA SA, VRB	4.25%	10/03/43	EUR	13,146	13,009,975	0.54
Banque Federative du Credit Mutuel SA	4.75%	10/11/31	EUR	13,300	14,129,780	0.59
BNP Paribas SA	1.38%	28/05/29	EUR	9,500	8,557,979	0.35
BNP Paribas SA, VRB	4.75%	13/11/32	EUR	19,500	20,710,005	0.86
BPCE SA	4.50%	13/01/33	EUR	10,200	10,739,046	0.45
BPCE SA, VRB	2.13%	13/10/46	EUR	15,600	12,714,488	0.53
Credit Agricole SA	4.00%	18/01/33	EUR	4,500	4,738,119	0.20
Credit Agricole SA	4.38%	27/11/33	EUR	8,500	8,935,157	0.37
Electricite de France SA	4.63%	25/01/43	EUR	18,400	19,428,578	0.81
Electricite de France SA, VRB	7.50%	31/12/49†	EUR	7,200	7,883,241	0.33
Electricite de France SA, VRB	9.13%	31/12/49†	USD	2,670	2,698,697	0.11
Electricite de France SA, VRB	3.00%	31/12/49†	EUR	3,600	3,290,594	0.14
Electricite de France SA, VRB	3.38%	31/12/49†	EUR	10,600	9,313,074	0.39
Electricite de France SA, VRB	4.00%	31/12/49†	EUR	20,600	20,469,648	0.85
Electricite de France SA, VRB	6.00%	31/12/49†	GBP	5,300	5,969,426	0.25
Engie SA	4.25%	06/09/34	EUR	5,400	5,734,451	0.24
Engie SA	4.50%	06/09/42	EUR	3,700	3,994,293	0.17
Französische Staatsanleihe OAT	1.00%	25/11/25	EUR	23,107	22,496,539	0.93
Französische Staatsanleihe OAT	0.75%	25/05/52	EUR	20,368	11,683,093	0.48

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
FRANKREICH (Fortsetzung)						
Französische Staatsanleihe OAT 144A	2.00%	25/05/48	EUR	27,036	22,370,628	0.93
Französische Staatsanleihe OAT 144A	1.75%	25/05/66	EUR	3,554	2,545,234	0.10
Französische Staatsanleihe OAT 144A	0.50%	25/05/72	EUR	2,800	1,174,867	0.05
Societe Generale SA, VRB	4.88%	21/11/31	EUR	3,000	3,141,045	0.13
Societe Generale SA, VRB	4.25%	06/12/30	EUR	10,100	10,278,051	0.43
Suez SACA	5.00%	03/11/32	EUR	9,200	10,189,272	0.42
Suez SACA	2.88%	24/05/34	EUR	6,100	5,699,409	0.24
TDF Infrastructure SASU	2.50%	07/04/26	EUR	10,100	9,862,195	0.41
Ubisoft Entertainment SA	0.88%	24/11/27	EUR	14,600	12,424,133	0.52
					284,181,017	11.82
DEUTSCHLAND						
Allianz SE, VRB	5.82%	25/07/53	EUR	11,500	12,606,742	0.52
Bayer AG	4.25%	26/08/29	EUR	5,823	6,041,398	0.25
Bayer AG	4.63%	26/05/33	EUR	5,831	6,098,048	0.25
Bayer AG, VRB	6.63%	25/09/83	EUR	4,200	4,285,355	0.18
Bayer AG, VRB	7.00%	25/09/83	EUR	3,700	3,828,906	0.16
Bundesobligation	2.40%	19/10/28	EUR	3,405	3,475,637	0.14
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.50%	15/02/26	EUR	4,249	4,094,154	0.17
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.50%	15/08/27	EUR	63,800	60,570,748	2.52
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	1.70%	15/08/32	EUR	1,718	1,682,499	0.07
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	2.30%	15/02/33	EUR	19,265	19,766,238	0.82
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	2.60%	15/08/33	EUR	10,510	11,034,517	0.46
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	4.75%	04/07/34	EUR	6,980	8,733,718	0.36
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.00%	15/05/36	EUR	11,973	9,184,645	0.38
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	4.75%	04/07/40	EUR	15,570	20,850,444	0.87
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	1.25%	15/08/48	EUR	26,047	21,169,405	0.88
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.00%	15/08/52	EUR	23,400	12,485,817	0.52
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	1.80%	15/08/53	EUR	39,939	36,053,390	1.50
Commerzbank AG, VRB	6.13%	31/12/49†	EUR	25,000	24,224,373	1.01
Commerzbank AG, VRB	6.50%	31/12/49†	EUR	11,200	10,658,841	0.44
Deutsche Bank AG, VRB	1.75%	19/11/30	EUR	16,700	14,540,922	0.61
Deutsche Bank AG, VRB	5.63%	19/05/31	EUR	10,600	10,752,416	0.45
Volkswagen Leasing GmbH	4.75%	25/09/31	EUR	2,857	3,049,937	0.13
					305,188,150	12.69
GRIECHENLAND						
Griechische Staatsanleihe 144A	4.25%	15/06/33	EUR	10,129	11,110,084	0.46
Griechische Staatsanleihe 144A	4.38%	18/07/38	EUR	32,726	35,982,001	1.50
					47,092,085	1.96
ISLAND						
Iceland Rikisbref	4.50%	17/02/42	ISK	3,320,270	17,509,430	0.73

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
IRLAND						
Irische Staatsanleihe	2.40%	15/05/30	EUR	1,342	1,356,224	0.06
Irische Staatsanleihe	1.35%	18/03/31	EUR	4,666	4,388,956	0.18
Irische Staatsanleihe	0.00%	18/10/31	EUR	11,286	9,470,424	0.39
Irische Staatsanleihe	2.00%	18/02/45	EUR	3,502	3,030,259	0.13
Johnson Controls International Plc	4.25%	23/05/35	EUR	5,061	5,372,791	0.22
					23,618,654	0.98
ISRAEL						
Israelische internationale Staatsanleihe	0.63%	18/01/32	EUR	39,058	30,222,802	1.26
ITALIEN						
ASTM SpA	1.50%	25/01/30	EUR	9,866	8,600,893	0.36
ASTM SpA	2.38%	25/11/33	EUR	6,569	5,529,482	0.23
Autostrade per l'Italia SpA	2.00%	04/12/28	EUR	10,653	9,808,051	0.41
Autostrade per l'Italia SpA	2.00%	15/01/30	EUR	8,448	7,509,211	0.31
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	9.13%	31/12/49†	EUR	5,960	6,569,331	0.27
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	1.35%	01/04/30	EUR	50,353	45,142,570	1.88
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A	1.45%	01/03/36	EUR	11,382	8,760,207	0.36
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A	4.75%	01/09/44	EUR	14,683	15,793,080	0.66
					107,712,825	4.48
LETTLAND						
Lettische internationale Staatsanleihe	3.50%	17/01/28	EUR	33,842	34,604,811	1.44
Lettische internationale Staatsanleihe	3.88%	12/07/33	EUR	16,300	17,090,919	0.71
					51,695,730	2.15
LITAUEN						
Litauische internationale Staatsanleihe	3.88%	14/06/33	EUR	30,640	32,182,355	1.34
LUXEMBURG						
Eurofins Scientific SE	4.75%	06/09/30	EUR	7,731	8,154,153	0.34
Medtronic Global Holdings SCA	1.50%	02/07/39	EUR	1,407	1,076,390	0.04
Medtronic Global Holdings SCA	1.63%	15/10/50	EUR	1,340	916,454	0.04
Simon International Finance SCA	1.13%	19/03/33	EUR	17,932	14,560,529	0.61
					24,707,526	1.03
MEXIKO						
Mexikanische internationale Staatsanleihe	4.00%	15/03/15^	EUR	66,119	51,293,578	2.13
NIEDERLANDE						
EnBW International Finance BV	4.30%	23/05/34	EUR	14,330	15,170,726	0.63
JAB Holdings BV	5.00%	12/06/33	EUR	11,700	12,632,012	0.53
Lseg Netherlands BV	4.23%	29/09/30	EUR	15,080	15,934,963	0.66
Telefonica Europe BV, VRB	2.38%	31/12/49†	EUR	2,000	1,741,387	0.07
Telefonica Europe BV, VRB	6.14%	31/12/49†	EUR	800	825,380	0.04
Telefonica Europe BV, VRB	2.88%	31/12/49†	EUR	3,600	3,361,557	0.14
Thermo Fisher Scientific Finance I BV	1.63%	18/10/41	EUR	1,942	1,469,290	0.06
Thermo Fisher Scientific Finance I BV	2.00%	18/10/51	EUR	3,481	2,503,578	0.10

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
NIEDERLANDE (Fortsetzung)						
Volkswagen International Finance NV, VRB	3.88%	31/12/49†	EUR	1,300	1,242,186	0.05
Volkswagen International Finance NV, VRB	4.63%	31/12/49†	EUR	700	679,836	0.03
Wintershall Dea Finance 2 BV, VRB	3.00%	31/12/49†	EUR	13,800	12,085,131	0.50
Wintershall Dea Finance BV	1.82%	25/09/31	EUR	5,900	5,091,686	0.21
					72,737,732	3.02
NORWEGEN						
Variable Energi ASA, VRB	7.86%	15/11/83	EUR	5,890	6,282,280	0.26
RUMÄNIEN						
Rumänische internationale Staatsanleihe	5.50%	18/09/28	EUR	15,480	15,941,523	0.66
Rumänische internationale Staatsanleihe	3.62%	26/05/30	EUR	959	883,408	0.04
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.12%	16/07/31	EUR	5,699	4,555,052	0.19
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.00%	28/01/32	EUR	4,399	3,413,961	0.14
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.00%	14/04/33	EUR	15,458	11,604,238	0.48
Rumänische internationale Staatsanleihe	3.88%	29/10/35	EUR	1,952	1,667,697	0.07
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.63%	02/12/40	EUR	47,886	32,327,706	1.34
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.75%	14/04/41	EUR	19,978	13,459,379	0.56
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.88%	13/04/42	EUR	38,407	26,084,648	1.09
Rumänische internationale Staatsanleihe	4.63%	03/04/49	EUR	4,248	3,577,946	0.15
Rumänische internationale Staatsanleihe	3.38%	28/01/50	EUR	8,297	5,674,696	0.24
					119,190,254	4.96
SLOWENIEN						
Slowenische Staatsanleihe	0.00%	12/02/31	EUR	11,434	9,395,405	0.39
SPANIEN						
Banco Santander SA	4.88%	18/10/31	EUR	10,200	10,876,117	0.45
CaixaBank SA	4.38%	29/11/33	EUR	10,800	11,363,590	0.47
CaixaBank SA, VRB	5.00%	19/07/29	EUR	1,700	1,779,528	0.08
CaixaBank SA, VRB	5.13%	19/07/34	EUR	9,200	9,840,781	0.41
CaixaBank SA, VRB	5.88%	31/12/49†	EUR	4,200	4,077,625	0.17
Spanische Staatsanleihe	0.25%	30/07/24	EUR	22,514	22,104,829	0.92
Spanische Staatsanleihe	0.00%	31/05/25	EUR	11,323	10,866,552	0.45
Spanische Staatsanleihe	0.00%	31/01/27	EUR	82,041	75,942,462	3.16
Spanische Staatsanleihe 144A	1.45%	31/10/27	EUR	4,591	4,414,255	0.18
Spanische Staatsanleihe 144A	1.95%	30/07/30	EUR	5,370	5,137,077	0.21
Spanische Staatsanleihe 144A	0.70%	30/04/32	EUR	66,563	56,170,102	2.34
Spanische Staatsanleihe 144A	2.55%	31/10/32	EUR	8,340	8,131,810	0.34
Spanische Staatsanleihe 144A	2.35%	30/07/33	EUR	8,761	8,331,556	0.35
Spanische Staatsanleihe 144A	1.00%	30/07/42	EUR	4,282	2,866,469	0.12
Spanische Staatsanleihe 144A	1.00%	31/10/50	EUR	27,345	15,414,158	0.64
					247,316,911	10.29
ÜBERSTAATLICHE EMITTENTEN						
Europäische Union	0.00%	04/10/28	EUR	52,386	46,766,460	1.95

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
ÜBERSTAATLICHE EMITTENTEN (Fortsetzung)						
Europäische Union	0.00%	04/07/35	EUR	22,737	16,596,277	0.69
Europäische Union	0.45%	04/07/41	EUR	24,143	15,848,517	0.66
Europäische Union	3.38%	04/11/42	EUR	19,381	20,236,890	0.84
Europäische Union	2.50%	04/10/52	EUR	8,186	7,278,737	0.30
					106,726,881	4.44
SCHWEDEN						
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, VRB	2.62%	31/12/49†	EUR	831	136,272	0.01
SCHWEIZ						
UBS Group AG, VRB	7.75%	01/03/29	EUR	22,675	26,158,712	1.09
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Barclays Plc, VRB	9.25%	31/12/49†	GBP	3,530	4,068,895	0.17
Barclays Plc, VRB	8.41%	14/11/32	GBP	4,606	5,675,793	0.24
HSBC Holdings Plc, VRB	6.80%	14/09/31	GBP	7,740	9,647,946	0.40
HSBC Holdings Plc, VRB	4.86%	23/05/33	EUR	9,260	9,839,357	0.41
Nationwide Building Society, VRB	5.75%	31/12/49†	GBP	5,196	5,544,437	0.23
NatWest Group Plc, VRB	6.00%	31/12/49†	USD	2,963	2,606,513	0.11
Swiss Re Finance UK Plc, VRB	2.71%	04/06/52	EUR	4,900	4,357,738	0.18
					41,740,679	1.74
VEREINIGTE STAATEN						
Carrier Global Corp	4.50%	29/11/32	EUR	5,555	5,950,092	0.25
Computershare US Inc	1.13%	07/10/31	EUR	12,556	9,849,509	0.41
Global Payments Inc	4.88%	17/03/31	EUR	5,477	5,759,692	0.24
					21,559,293	0.90
ANLEIHEN INSGESAMT					1,798,810,642	74.82
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt					1,798,810,642	74.82
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
FRANKREICH						
Französische Staatsanleihe OAT	2.50%	25/05/30	EUR	101,885	103,181,472	4.29
Societe Generale SA, VRB	9.38%	31/12/49†	USD	3,660	3,464,952	0.15
					106,646,424	4.44
DEUTSCHLAND						
Deutsche Bank AG/New York NY, VRB	3.55%	18/09/31	USD	12,052	9,590,722	0.40
Robert Bosch GmbH	4.00%	02/06/35	EUR	5,300	5,625,537	0.23
Robert Bosch GmbH	4.38%	02/06/43	EUR	6,200	6,668,689	0.28
					21,884,948	0.91
ITALIEN						
Intesa Sanpaolo SpA	5.13%	29/08/31	EUR	17,110	18,279,266	0.76
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	7.75%	31/12/49†	EUR	12,229	12,569,934	0.52
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	0.35%	01/02/25	EUR	8,608	8,348,128	0.35
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	1.50%	01/06/25	EUR	45,800	44,832,837	1.87
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	1.60%	01/06/26	EUR	25,457	24,765,139	1.03
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	2.00%	01/02/28	EUR	28,010	27,081,781	1.13

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
ITALIEN (Fortsetzung)						
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A	4.75%	01/09/28	EUR	23,000	24,772,241	1.03
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A	0.60%	01/08/31	EUR	75,604	61,784,598	2.57
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A	0.95%	01/12/31	EUR	15,360	12,774,835	0.53
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A	2.95%	01/09/38	EUR	17,664	15,658,929	0.65
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A	3.85%	01/09/49	EUR	7,489	7,075,206	0.29
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A	2.45%	01/09/50	EUR	5,700	4,168,430	0.17
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A	2.15%	01/09/52	EUR	18,809	12,517,937	0.52
					274,629,261	11.42
JAPAN						
East Japan Railway Co	4.39%	05/09/43	EUR	10,380	11,299,126	0.47
NIEDERLANDE						
Sartorius Finance BV	4.38%	14/09/29	EUR	4,000	4,149,192	0.17
Sartorius Finance BV	4.50%	14/09/32	EUR	2,900	3,026,676	0.13
Sartorius Finance BV	4.88%	14/09/35	EUR	2,900	3,064,264	0.13
					10,240,132	0.43
RUMÄNIEN						
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.88%	26/05/28	EUR	6,856	6,419,512	0.27
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.50%	08/02/30	EUR	1,961	1,703,502	0.07
Rumänische internationale Staatsanleihe	3.38%	08/02/38	EUR	3,272	2,566,276	0.10
					10,689,290	0.44
SCHWEIZ						
UBS Group AG 144A, VRB	9.02%	15/11/33	USD	4,430	4,936,373	0.20
					4,936,373	0.20
ANLEIHEN INSGESAMT					440,325,554	18.31
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt					440,325,554	18.31
Anlagen insgesamt (Kosten EUR 2,397,442,812)					2,239,136,196	93.13
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					165,166,777	6.87
Nettovermögen insgesamt					2,404,302,973	100.00

Glossar:

VRB - Variable Rate Bond (variabel verzinsliche Anleihe)

† Unbefristete Laufzeit

^ Fälligkeitsdatum ist der 15. März 2115

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.

Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
ÖSTERREICH						
Benteler International AG	9.38%	15/05/28	EUR	4,277	5,063,980	0.32
KOLUMBIEN						
Ecopetrol SA	8.88%	13/01/33	USD	7,549	8,210,715	0.52
DÄNEMARK						
TDC Net A/S	6.50%	01/06/31	EUR	5,050	5,912,806	0.38
FRANKREICH						
Accor SA, VRB	7.25%	31/12/49†	EUR	3,300	3,975,136	0.26
Altice France SA/France 144A	5.50%	15/10/29	USD	13,979	10,978,888	0.70
Banjay Group SAS	6.50%	01/03/26	EUR	7,079	7,831,899	0.50
Electricite de France SA, VRB	7.50%	31/12/49†	EUR	3,800	4,593,124	0.29
Electricite de France SA, VRB	3.00%	31/12/49†	EUR	9,200	9,291,362	0.59
Electricite de France SA, VRB	3.38%	31/12/49†	EUR	8,600	8,363,791	0.53
Electricite de France SA, VRB	6.00%	31/12/49†	GBP	4,700	5,849,124	0.37
Societe Generale SA, VRB	7.88%	31/12/49†	EUR	6,100	6,966,330	0.45
					57,849,654	3.69
DEUTSCHLAND						
Bayer AG, VRB	6.63%	25/09/83	EUR	4,600	5,191,300	0.33
Bayer AG, VRB	7.00%	25/09/83	EUR	4,100	4,686,862	0.30
Cheplapharm Arzneimittel GmbH 144A	5.50%	15/01/28	USD	13,181	12,477,960	0.80
Commerzbank AG, VRB	6.13%	31/12/49†	EUR	12,000	12,835,710	0.82
Deutsche Bank AG, VRB	10.00%	31/12/49†	EUR	7,800	9,423,890	0.60
IHO Verwaltungs GmbH, PIK	8.75%	15/05/28	EUR	8,900	10,734,299	0.68
					55,350,021	3.53
IRLAND						
Bank of Ireland Group Plc, VRB	6.00%	31/12/49†	EUR	4,700	5,131,188	0.33
ITALIEN						
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	10.50%	23/07/29	EUR	4,737	5,759,746	0.37
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	9.13%	31/12/49†	EUR	5,050	6,151,850	0.39
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	5.88%	31/12/49†	EUR	4,500	4,937,968	0.32
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	5.88%	31/12/49†	EUR	8,160	8,153,302	0.52
Telecom Italia SpA/Milano	6.88%	15/02/28	EUR	11,522	13,587,437	0.87
Telecom Italia SpA/Milano	7.88%	31/07/28	EUR	5,405	6,649,494	0.42
UniCredit SpA, VRB	4.45%	31/12/49†	EUR	5,759	5,674,586	0.36
UniCredit SpA, VRB	7.50%	31/12/49†	EUR	7,605	8,666,582	0.55
					59,580,965	3.80
JAPAN						
SoftBank Group Corp	3.38%	06/07/29	EUR	6,244	6,208,657	0.39
SoftBank Group Corp	3.88%	06/07/32	EUR	5,760	5,481,061	0.35
					11,689,718	0.74
LUXEMBURG						
Aegea Finance Sarl	6.75%	20/05/29	USD	9,804	9,641,836	0.62
Altice Financing SA	3.00%	15/01/28	EUR	5,589	5,531,804	0.35
Altice Financing SA 144A	5.75%	15/08/29	USD	8,227	7,311,692	0.47
Cidron Aida Finco Sarl	5.00%	01/04/28	EUR	10,034	10,704,351	0.68

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
LUXEMBURG (Fortsetzung)						
Dana Financing Luxembourg Sarl	8.50%	15/07/31	EUR	5,360	6,496,764	0.41
					39,686,447	2.53
MULTINATIONAL						
GEMS MENASA Cayman Ltd / GEMS Education Delaware LLC 144A	7.13%	31/07/26	USD	13,645	13,442,236	0.86
Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co.-Issuer, Inc. 144A, PIK	7.63%	15/10/25	USD	12,498	12,713,864	0.81
					26,156,100	1.67
NIEDERLANDE						
Abertis Infraestructuras Finance BV, VRB	2.63%	31/12/49†	EUR	11,500	11,601,270	0.74
GTCR W-2 Merger Sub LLC / GTCR W Dutch Finance Sub BV	8.50%	15/01/31	GBP	4,900	6,772,789	0.43
Heimstaden Bostad Treasury BV	1.63%	13/10/31	EUR	11,570	8,109,955	0.52
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	7.38%	15/09/29	EUR	3,600	4,362,448	0.28
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	7.88%	15/09/31	EUR	4,440	5,572,286	0.36
United Group BV	5.25%	01/02/30	EUR	10,227	10,738,380	0.68
Wintershall Dea Finance 2 BV, VRB	3.00%	31/12/49†	EUR	15,800	15,287,058	0.97
ZF Europe Finance BV	6.13%	13/03/29	EUR	3,400	4,001,947	0.26
					66,446,133	4.24
NORWEGEN						
Variable Energi ASA, VRB	7.86%	15/11/83	EUR	8,861	10,447,937	0.67
SPANIEN						
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, VRB	6.00%	31/12/49†	EUR	5,200	5,722,295	0.37
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, VRB	8.38%	31/12/49†	EUR	6,400	7,679,527	0.49
Banco de Sabadell SA, VRB	9.38%	31/12/49†	EUR	8,400	9,947,978	0.63
CaixaBank SA, VRB	3.63%	31/12/49†	EUR	7,000	5,988,589	0.38
Ibercaja Banco SA, VRB	2.75%	23/07/30	EUR	6,200	6,570,733	0.42
					35,909,122	2.29
SCHWEDEN						
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB	1.75%	14/01/25	EUR	5,490	5,255,624	0.34
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB	2.38%	04/09/26	EUR	6,080	4,869,117	0.31
Verisure Holding AB	9.25%	15/10/27	EUR	4,234	5,037,467	0.32
					15,162,208	0.97
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Allwyn Entertainment Financing UK Plc	7.25%	30/04/30	EUR	4,880	5,688,542	0.36
Barclays Plc, VRB	9.25%	31/12/49†	GBP	7,584	9,659,923	0.62
Barclays Plc, VRB	7.13%	31/12/49†	GBP	5,238	6,511,355	0.41
Jaguar Land Rover Automotive Plc	4.50%	15/07/28	EUR	6,715	7,266,218	0.46
Jaguar Land Rover Automotive Plc 144A	5.50%	15/07/29	USD	4,664	4,550,713	0.29
Lloyds Banking Group Plc, VRB	8.50%	31/12/49†	GBP	6,520	8,473,608	0.54

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)						
Vodafone Group Plc, VRB	8.00%	30/08/86	GBP	6,043	8,246,875	0.53
					50,397,234	3.21
VEREINIGTE STAATEN						
Belden Inc	3.38%	15/07/31	EUR	8,917	8,713,484	0.56
Brandywine Operating Partnership LP	7.80%	15/03/28	USD	7,475	7,568,275	0.48
Comerica Inc	4.00%	01/02/29	USD	7,206	6,819,039	0.43
Global Partners LP / GLP Finance Corp	7.00%	01/08/27	USD	4,963	4,856,891	0.31
Kosmos Energy Ltd 144A	7.75%	01/05/27	USD	12,046	11,235,694	0.72
OneMain Finance Corp	9.00%	15/01/29	USD	4,712	4,985,668	0.32
Piedmont Operating Partnership LP	9.25%	20/07/28	USD	6,305	6,664,645	0.42
					50,843,696	3.24
					503,837,924	32.13
OPTIONSSCHEINE						
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Avation Plc			GBP	199	50,637	0.00
					50,637	0.00
OPTIONSSCHEINE INSGESAMT						
					50,637	0.00
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt					503,888,561	32.13
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
AUSTRALIEN						
FMG Resources August 2006 Pty Ltd 144A	5.88%	15/04/30	USD	5,366	5,324,295	0.34
Mineral Resources Ltd 144A	9.25%	01/10/28	USD	5,172	5,508,283	0.35
Mineral Resources Ltd 144A	8.50%	01/05/30	USD	6,343	6,620,450	0.43
					17,453,028	1.12
ÖSTERREICH						
Benteler International AG 144A	10.50%	15/05/28	USD	6,326	6,669,028	0.43
KANADA						
Baytex Energy Corp 144A	8.50%	30/04/30	USD	7,508	7,776,561	0.50
Bombardier Inc 144A	6.00%	15/02/28	USD	6,480	6,321,113	0.40
Bombardier Inc 144A	7.50%	01/02/29	USD	4,682	4,763,645	0.30
Intelligent Packaging Ltd Finco, Inc. / Intelligent Packaging Ltd Co.-Issuer LLC 144A	6.00%	15/09/28	USD	12,357	11,542,303	0.74
NOVA Chemicals Corp 144A	4.25%	15/05/29	USD	18,608	15,689,542	1.00
					46,093,164	2.94
KAIMANINSELN						
Global Aircraft Leasing Co Ltd 144A, PIK	6.50%	15/09/24	USD	14,831	13,958,492	0.89
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd 144A	5.75%	20/01/26	USD	5,615	5,294,311	0.34
Transocean Inc 144A	8.75%	15/02/30	USD	6,523	6,819,845	0.43

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
KAIMANINSELN (Fortsetzung)						
Transocean Titan Financing Ltd 144A	8.38%	01/02/28	USD	5,593	5,806,554	0.37
					31,879,202	2.03
FRANKREICH						
Iliad Holding SASU 144A	6.50%	15/10/26	USD	13,051	13,034,797	0.83
Iliad Holding SASU 144A	7.00%	15/10/28	USD	6,267	6,240,767	0.40
Societe Generale SA, VRB	9.38%	31/12/49†	USD	5,274	5,530,411	0.35
					24,805,975	1.58
DEUTSCHLAND						
Cerdia Finanz GmbH 144A	10.50%	15/02/27	USD	11,570	11,802,788	0.75
IRLAND						
LCPR Senior Secured Financing DAC 144A	6.75%	15/10/27	USD	15,339	15,039,353	0.96
ISRAEL						
Energear Israel Finance Ltd 144A	8.50%	30/09/33	USD	10,677	10,236,574	0.65
ITALIEN						
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA, VRB	7.71%	18/01/28	EUR	4,333	4,798,716	0.31
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA, VRB	8.50%	10/09/30	EUR	8,551	9,520,957	0.61
Lottomatica SpA/Rom	7.13%	01/06/28	EUR	2,424	2,830,633	0.18
					17,150,306	1.10
JERSEY						
Adient Global Holdings Ltd 144A	8.25%	15/04/31	USD	5,800	6,146,225	0.39
LUXEMBURG						
Aegea Finance Sarl	9.00%	20/01/31	USD	6,020	6,402,872	0.41
Altice France Holding SA 144A	10.50%	15/05/27	USD	6,800	4,410,746	0.28
CSN Resources SA	8.88%	05/12/30	USD	4,884	5,094,110	0.33
CSN Resources SA	5.88%	08/04/32	USD	7,519	6,546,523	0.42
Guara Norte Sarl	5.20%	15/06/34	USD	5,538	5,051,492	0.32
Minerva Luxembourg SA	8.88%	13/09/33	USD	9,843	10,424,170	0.66
					37,929,913	2.42
MAURITIUS						
CA Magnum Holdings 144A	5.38%	31/10/26	USD	13,076	12,193,370	0.78
MEXIKO						
Petroleos Mexicanos	8.75%	02/06/29	USD	5,030	4,893,461	0.31
Petroleos Mexicanos	6.84%	23/01/30	USD	11,334	9,838,930	0.63
Petroleos Mexicanos	5.95%	28/01/31	USD	6,659	5,325,502	0.34
Petroleos Mexicanos	10.00%	07/02/33	USD	6,297	6,329,631	0.40
					26,387,524	1.68
PANAMA						
Carnival Corp 144A	9.88%	01/08/27	USD	7,051	7,406,913	0.47

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
PUERTO RICO						
Popular Inc	7.25%	13/03/28	USD	7,740	7,971,078	0.51
SCHWEIZ						
Credit Suisse Group AG, FTB ±#	9.75%	31/12/49†	USD	8,207	984,840	0.06
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Allwyn Entertainment Financing UK Plc 144A	7.88%	30/04/29	USD	5,463	5,585,918	0.35
MARB BondCo Plc	3.95%	29/01/31	USD	12,853	10,448,512	0.67
					16,034,430	1.02
VEREINIGTE STAATEN						
ADT Security Corp 144A	4.13%	01/08/29	USD	6,315	5,818,324	0.37
American Airlines Inc 144A	7.25%	15/02/28	USD	6,013	6,087,231	0.39
AmeriTex HoldCo Intermediate LLC 144A	10.25%	15/10/28	USD	9,270	9,513,338	0.61
Arsenal AIC Parent LLC 144A	8.00%	01/10/30	USD	4,261	4,451,083	0.28
Azul Secured Finance LLP	11.93%	28/08/28	USD	4,522	4,682,183	0.30
BCPE Ulysses Intermediate Inc 144A, PIK	7.75%	01/04/27	USD	8,192	7,650,006	0.49
Bread Financial Holdings Inc 144A	7.00%	15/01/26	USD	5,127	5,100,493	0.32
Cablevision Lightpath LLC 144A	5.63%	15/09/28	USD	7,066	5,576,275	0.36
Camelot Return Merger Sub Inc 144A	8.75%	01/08/28	USD	7,324	7,443,558	0.47
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 144A	6.38%	01/09/29	USD	18,113	17,886,455	1.14
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 144A	7.38%	01/03/31	USD	7,318	7,515,506	0.48
Central Parent LLC / CDK Global II LLC / CDK Financing Co Inc 144A	8.00%	15/06/29	USD	5,303	5,539,143	0.35
Chart Industries Inc 144A	7.50%	01/01/30	USD	4,592	4,805,514	0.31
Chart Industries Inc 144A	9.50%	01/01/31	USD	7,074	7,689,445	0.49
CITGO Petroleum Corp 144A	7.00%	15/06/25	USD	5,354	5,349,863	0.34
CITGO Petroleum Corp 144A	8.38%	15/01/29	USD	14,261	14,676,708	0.94
Civitas Resources Inc 144A	8.38%	01/07/28	USD	9,773	10,214,691	0.65
Civitas Resources Inc 144A	8.75%	01/07/31	USD	7,305	7,785,647	0.50
Cloud Software Group Inc 144A	9.00%	30/09/29	USD	8,020	7,629,529	0.49
CMG Media Corp 144A	8.88%	15/12/27	USD	8,100	6,431,927	0.41
Coherent Corp 144A	5.00%	15/12/29	USD	5,438	5,170,450	0.33
Coinbase Global Inc 144A	3.38%	01/10/28	USD	7,002	5,916,121	0.38
CQP Holdco LP / BIP-V Chinook Holdco LLC 144A	5.50%	15/06/31	USD	8,289	7,866,339	0.50
CQP Holdco LP / BIP-V Chinook Holdco LLC 144A	7.50%	15/12/33	USD	8,189	8,496,391	0.54
CSC Holdings LLC 144A	5.50%	15/04/27	USD	7,525	6,960,377	0.44
CSC Holdings LLC 144A	5.75%	15/01/30	USD	12,582	7,845,380	0.50
Dealer Tire LLC / DT Issuer LLC 144A	8.00%	01/02/28	USD	7,601	7,533,845	0.48
DISH DBS Corp 144A	5.25%	01/12/26	USD	12,555	10,780,037	0.69
DISH DBS Corp 144A	5.75%	01/12/28	USD	7,078	5,658,684	0.36
DISH Network Corp 144A	11.75%	15/11/27	USD	6,186	6,462,341	0.41
Domtar Corp 144A	6.75%	01/10/28	USD	15,958	14,444,213	0.92
EQM Midstream Partners LP 144A	7.50%	01/06/30	USD	9,429	10,147,103	0.65
Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp 144A	5.38%	01/04/26	USD	10,062	9,856,669	0.63
Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp 144A	5.88%	01/04/29	USD	4,965	4,695,439	0.30
Freedom Mortgage Corp 144A	6.63%	15/01/27	USD	5,276	5,040,707	0.32
Freedom Mortgage Corp 144A	12.00%	01/10/28	USD	5,144	5,621,966	0.36
Global Infrastructure Solutions Inc 144A	5.63%	01/06/29	USD	8,587	7,851,964	0.50

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)						
Global Partners LP / GLP Finance Corp	6.88%	15/01/29	USD	6,670	6,466,460	0.41
GPD Cos Inc 144A	10.13%	01/04/26	USD	4,956	4,586,778	0.29
Gray Television Inc 144A	7.00%	15/05/27	USD	12,727	12,109,168	0.77
Griffon Corp	5.75%	01/03/28	USD	8,084	7,952,918	0.51
Hanesbrands Inc 144A	9.00%	15/02/31	USD	7,740	7,591,747	0.48
Iron Mountain Inc 144A	7.00%	15/02/29	USD	5,730	5,893,322	0.38
ITT Holdings LLC 144A	6.50%	01/08/29	USD	15,860	14,046,647	0.90
Jefferies Finance LLC / JFIN Co-Issuer Corp. 144A	5.00%	15/08/28	USD	5,210	4,669,328	0.30
KeyCorp, VRB	3.88%	23/05/25	USD	6,641	6,493,935	0.41
Knife River Corp 144A	7.75%	01/05/31	USD	5,320	5,668,380	0.36
Kronos Acquisition Holdings Inc / KIK Custom Products Inc 144A	7.00%	31/12/27	USD	5,213	4,984,097	0.32
LBM Acquisition LLC 144A	6.25%	15/01/29	USD	5,881	5,257,467	0.33
Level 3 Financing Inc 144A	4.63%	15/09/27	USD	2,945	1,769,724	0.11
Level 3 Financing Inc 144A	10.50%	15/05/30	USD	5,049	4,900,735	0.31
LifePoint Health Inc 144A	5.38%	15/01/29	USD	6,971	5,162,431	0.33
LifePoint Health Inc 144A	9.88%	15/08/30	USD	10,370	10,492,788	0.67
Macy's Retail Holdings LLC 144A	6.13%	15/03/32	USD	6,800	6,442,830	0.41
McAfee Corp 144A	7.38%	15/02/30	USD	8,749	8,001,717	0.51
Mercury Chile Holdco LLC	6.50%	24/01/27	USD	18,510	17,265,960	1.10
Nabors Industries Inc 144A	9.13%	31/01/30	USD	4,938	4,962,320	0.32
Neptune Bidco US Inc 144A	9.29%	15/04/29	USD	8,169	7,624,272	0.49
Noble Finance II LLC 144A	8.00%	15/04/30	USD	4,521	4,708,160	0.30
NRG Energy Inc 144A, VRB	10.25%	31/12/49†	USD	11,157	11,626,498	0.74
OT Merger Corp 144A	7.88%	15/10/29	USD	8,928	5,357,464	0.34
Paramount Global, VRB	6.38%	30/03/62	USD	14,800	13,337,760	0.85
Permian Resources Operating LLC 144A	7.75%	15/02/26	USD	4,897	4,986,272	0.32
Permian Resources Operating LLC 144A	8.00%	15/04/27	USD	4,630	4,803,907	0.31
Permian Resources Operating LLC 144A	9.88%	15/07/31	USD	5,479	6,094,730	0.39
Rand Parent LLC 144A	8.50%	15/02/30	USD	7,620	7,295,621	0.46
Rayonier AM Products Inc 144A	7.63%	15/01/26	USD	13,571	12,468,696	0.79
Sinclair Television Group Inc 144A	5.50%	01/03/30	USD	6,508	4,889,526	0.31
Sinclair Television Group Inc 144A	4.13%	01/12/30	USD	10,325	7,291,980	0.46
Smyrna Ready Mix Concrete LLC 144A	6.00%	01/11/28	USD	14,093	13,896,324	0.89
Specialty Building Products Holdings LLC / SBP Finance Corp 144A	6.38%	30/09/26	USD	7,828	7,684,783	0.49
Spirit AeroSystems Inc 144A	9.75%	15/11/30	USD	8,562	9,214,630	0.59
Talen Energy Supply LLC 144A	8.63%	01/06/30	USD	6,862	7,296,209	0.47
Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp 144A	6.00%	01/03/27	USD	4,987	4,881,724	0.31
Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp 144A	6.00%	31/12/30	USD	10,199	9,495,551	0.61
TEGNA Inc	5.00%	15/09/29	USD	5,743	5,269,375	0.34
Tenet Healthcare Corp	6.13%	01/10/28	USD	5,285	5,274,694	0.34
Tenneco Inc 144A	8.00%	17/11/28	USD	8,512	7,274,866	0.46
Uniti Group LP / Uniti Group Finance Inc / CSL Capital LLC 144A	10.50%	15/02/28	USD	4,868	4,939,365	0.31
Univision Communications Inc 144A	6.63%	01/06/27	USD	4,725	4,715,539	0.30
Univision Communications Inc 144A	7.38%	30/06/30	USD	6,123	6,112,573	0.39
Venture Global LNG Inc 144A	8.13%	01/06/28	USD	4,665	4,715,415	0.30
Venture Global LNG Inc 144A	9.50%	01/02/29	USD	5,335	5,648,655	0.36
Viasat Inc 144A	7.50%	30/05/31	USD	8,824	6,937,870	0.44
Vibrantz Technologies Inc 144A	9.00%	15/02/30	USD	6,866	5,453,122	0.35

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)						
Vistra Operations Co LLC 144A	7.75%	15/10/31	USD	9,063	9,419,529	0.60
Voyager Aviation Holdings LLC 144A ^a	8.50%	09/05/26	USD	13,340	10,941,012	0.70
White Capital Parent LLC 144A, PIK	8.25%	15/03/26	USD	7,191	7,167,004	0.46
Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp 144A	7.13%	15/02/31	USD	13,344	13,912,214	0.89
XPO Inc 144A	7.13%	01/02/32	USD	4,934	5,095,376	0.32
					672,744,413	42.90
ANLEIHEN INSGESAMT					968,928,124	61.79
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt					968,928,124	61.79
Sonstige Wertpapiere						
ANLEIHEN						
AUSTRALIEN						
Quintis Australia Pty Ltd 144A, PIK ^a	7.50%	01/10/26	USD	8,120	2,338,428	0.15
Quintis Australia Pty Ltd 144A, PIK ^a	0.00%	01/10/28	USD	4,135	0	0.00
					2,338,428	0.15
ANLEIHEN INSGESAMT					2,338,428	0.15
STAMMAKTIEN						
AUSTRALIEN						
Quintis Ltd ^a			USD	2,020	0	0.00
VEREINIGTE STAATEN						
Voyager			USD	20	204	0.00
Voyager			USD	3	0	0.00
W.R. Grace & Co			USD	820	82	0.00
					286	0.00
STAMMAKTIEN INSGESAMT					286	0.00
OPTIONSSCHEINE						
MEXIKO						
Urbi Warrant			MXN	70	0	0.00
OPTIONSSCHEINE INSGESAMT					0	0.00
Sonstige Wertpapiere insgesamt					2,338,714	0.15

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Anlagen insgesamt <i>(Kosten USD 1,513,546,409)</i>	1,475,155,399	94.07
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten	92,996,972	5.93
Nettovermögen insgesamt	1,568,152,371	100.00

Glossar:

FTB - Flat Trading Bond (pauschal gehandelte Anleihe)

PIK - Payment-in-Kind (Sachleistung)

VRB - Variable Rate Bond (variabel verzinsliche Anleihe)

± notleidendes Wertpapier

† Unbefristete Laufzeit

α Wertpapier zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Die Investition stellt eine zum beizulegenden Zeitwert bewertete Forderung dar

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.

Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
ÖSTERREICH						
Suzano Austria GmbH	6.00%	15/01/29	USD	154	157,200	0.13
Suzano Austria GmbH	3.75%	15/01/31	USD	470	413,233	0.36
Suzano Austria GmbH	3.13%	15/01/32	USD	348	288,949	0.25
					<u>859,382</u>	<u>0.74</u>
BRITISCHE JUNGFERNINSELN						
CAS Capital No 1 Ltd, VRB	4.00%	31/12/49†	USD	635	549,771	0.48
Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd	6.13%	15/05/29	USD	631	647,761	0.56
					<u>1,197,532</u>	<u>1.04</u>
KANADA						
MEGlobal Canada ULC	5.00%	18/05/25	USD	1,328	1,315,384	1.14
					<u>1,315,384</u>	<u>1.14</u>
KAIMANINSELN						
Alibaba Group Holding Ltd	3.15%	09/02/51	USD	807	536,239	0.47
Alibaba Group Holding Ltd	3.25%	09/02/61	USD	643	406,794	0.35
DP World Crescent Ltd	5.50%	13/09/33	USD	570	584,566	0.51
MAF Sukuk Ltd	3.93%	28/02/30	USD	540	506,925	0.44
Meituan	2.13%	28/10/25	USD	590	556,223	0.48
QNB Finance Ltd	2.63%	12/05/25	USD	640	617,600	0.54
Sands China Ltd	5.38%	08/08/25	USD	1,116	1,100,829	0.95
Saudi Electricity Sukuk Programme Co	5.68%	11/04/53	USD	600	615,188	0.53
					<u>4,924,364</u>	<u>4.27</u>
KOLUMBIEN						
Ecopetrol SA	8.88%	13/01/33	USD	384	417,600	0.36
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.38%	15/02/31	USD	508	416,964	0.36
					<u>834,564</u>	<u>0.72</u>
HONGKONG						
Airport Authority, VRB	2.10%	31/12/49†	USD	550	513,650	0.45
Airport Authority, VRB	2.40%	31/12/49†	USD	950	846,745	0.73
Swire Properties MTN Financing Ltd	3.50%	10/01/28	USD	633	601,312	0.52
Xiaomi Best Time International Ltd	2.88%	14/07/31	USD	216	178,940	0.15
					<u>2,140,647</u>	<u>1.85</u>
INDIEN						
Adani Electricity Mumbai Ltd	3.87%	22/07/31	USD	610	474,752	0.41
Adani International Container Terminal Pvt Ltd	3.00%	16/02/31	USD	533	439,896	0.38
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd	4.00%	30/07/27	USD	496	443,533	0.39
Power Finance Corp Ltd	4.50%	18/06/29	USD	489	475,464	0.41
REC Ltd	2.25%	01/09/26	USD	1,083	1,000,919	0.87
Reliance Industries Ltd	4.13%	28/01/25	USD	220	217,383	0.19
Shriram Finance Ltd	4.40%	13/03/24	USD	714	708,966	0.61
					<u>3,760,913</u>	<u>3.26</u>
INSEL MAN						
AngloGold Ashanti Holdings Plc	3.38%	01/11/28	USD	800	723,648	0.63

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
INSEL MAN (Fortsetzung)						
Gohl Capital Ltd	4.25%	24/01/27	USD	1,412	1,356,844	1.17
					2,080,492	1.80
ISRAEL						
Bank Hapoalim BM 144A, VRB	3.26%	21/01/32	USD	1,402	1,217,330	1.06
Bank Leumi Le-Israel BM 144A, VRB	7.13%	18/07/33	USD	379	374,263	0.32
Israel Electric Corp Ltd 144A	5.00%	12/11/24	USD	571	564,179	0.49
Israel Electric Corp Ltd 144A	4.25%	14/08/28	USD	310	290,413	0.25
Israel Electric Corp Ltd 144A	3.75%	22/02/32	USD	200	170,042	0.15
Leviathan Bond Ltd 144A	6.50%	30/06/27	USD	346	326,916	0.28
					2,943,143	2.55
JERSEY						
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd	2.94%	30/09/40	USD	2,754	2,280,356	1.98
KASACHSTAN						
KazMunayGas National Co JSC	5.75%	19/04/47	USD	1,261	1,110,468	0.96
KazMunayGas National Co JSC	6.38%	24/10/48	USD	587	554,073	0.48
					1,664,541	1.44
LUXEMBURG						
Chile Electricity Lux MPC Sarl	6.01%	20/01/33	USD	360	371,306	0.32
EIG Pearl Holdings Sarl	3.55%	31/08/36	USD	1,468	1,282,665	1.11
EIG Pearl Holdings Sarl	4.39%	30/11/46	USD	555	446,688	0.39
Greensaif Pipelines Bidco Sarl	6.13%	23/02/38	USD	321	336,047	0.29
Greensaif Pipelines Bidco Sarl	6.51%	23/02/42	USD	787	830,900	0.72
					3,267,606	2.83
MALAYSIA						
GENM Capital Labuan Ltd	3.88%	19/04/31	USD	1,626	1,393,533	1.21
MAURITIUS						
Network i2i Ltd, VRB	5.65%	31/12/49†	USD	807	796,282	0.69
MEXIKO						
America Movil SAB de CV	4.38%	22/04/49	USD	1,659	1,476,510	1.28
Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, VRB	6.75%	31/12/49†	USD	555	549,899	0.47
Mexico City Airport Trust	5.50%	31/07/47	USD	489	423,073	0.37
					2,449,482	2.12
NIEDERLANDE						
Braskem Netherlands Finance BV	7.25%	13/02/33	USD	560	470,400	0.41
MV24 Capital BV	6.75%	01/06/34	USD	484	452,581	0.39
Prosus NV	4.19%	19/01/32	USD	701	605,379	0.52
Prosus NV	1.99%	13/07/33	EUR	388	317,756	0.28
Prosus NV	4.99%	19/01/52	USD	591	444,266	0.39
Royal Capital BV, VRB	5.00%	31/12/49†	USD	548	536,184	0.46
					2,826,566	2.45
PERU						
Fondo MIVIVIENDA SA	4.63%	12/04/27	USD	650	635,092	0.55

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
PERU (Fortsetzung)						
Kallpa Generacion SA	4.13%	16/08/27	USD	395	377,781	0.33
					<u>1,012,873</u>	<u>0.88</u>
SINGAPUR						
BOC Aviation Ltd	4.50%	23/05/28	USD	720	705,333	0.61
SÜDKOREA						
POSCO	5.88%	17/01/33	USD	200	209,635	0.18
Woori Bank	4.88%	26/01/28	USD	546	549,093	0.48
					<u>758,728</u>	<u>0.66</u>
ÜBERSTAATLICHE EMITTENTEN						
Africa Finance Corp	4.38%	17/04/26	USD	633	609,832	0.53
African Export-Import Bank	3.99%	21/09/29	USD	1,620	1,446,103	1.25
					<u>2,055,935</u>	<u>1.78</u>
THAILAND						
Bangkok Bank PCL/Hong Kong	4.30%	15/06/27	USD	1,815	1,780,678	1.54
Bangkok Bank PCL/Hong Kong, VRB	3.47%	23/09/36	USD	682	572,259	0.50
GC Treasury Center Co Ltd	4.40%	30/03/32	USD	910	832,987	0.72
GC Treasury Center Co Ltd	4.30%	18/03/51	USD	540	409,301	0.36
PTTEP Treasury Center Co Ltd	3.90%	06/12/59	USD	217	177,593	0.15
Thaioil Treasury Center Co Ltd	3.75%	18/06/50	USD	879	624,152	0.54
					<u>4,396,970</u>	<u>3.81</u>
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE						
Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	3.50%	31/03/27	USD	1,021	971,545	0.84
Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	4.50%	14/09/27	USD	981	963,373	0.84
Emirates NBD Bank PJSC	5.63%	21/10/27	USD	396	402,930	0.35
First Abu Dhabi Bank PJSC	5.13%	13/10/27	USD	2,031	2,047,184	1.77
First Abu Dhabi Bank PJSC, VRB	6.32%	04/04/34	USD	1,330	1,373,641	1.19
NBK SPC Ltd, VRB	1.63%	15/09/27	USD	2,719	2,469,192	2.14
Nbk Tier 2 Ltd, VRB	2.50%	24/11/30	USD	906	849,800	0.74
Sweihan PV Power Co PJSC	3.63%	31/01/49	USD	1,406	1,155,163	1.00
					<u>10,232,828</u>	<u>8.87</u>
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Anglo American Capital Plc	5.63%	01/04/30	USD	1,041	1,059,603	0.92
Antofagasta Plc	5.63%	13/05/32	USD	670	669,058	0.58
Standard Chartered Plc, VRB	6.30%	09/01/29	USD	750	770,160	0.67
Standard Chartered Plc, VRB	7.78%	16/11/25	USD	400	407,622	0.35
Standard Chartered Plc, VRB	6.17%	09/01/27	USD	320	324,925	0.28
Standard Chartered Plc, VRB	4.64%	01/04/31	USD	201	189,637	0.17
					<u>3,421,005</u>	<u>2.97</u>
VEREINIGTE STAATEN						
DAE Funding LLC	3.38%	20/03/28	USD	1,033	954,786	0.83
Hikma Finance USA LLC	3.25%	09/07/25	USD	1,117	1,071,622	0.93
Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc	4.63%	06/04/31	USD	600	493,500	0.43
Stillwater Mining Co	4.00%	16/11/26	USD	200	178,000	0.15
Stillwater Mining Co	4.50%	16/11/29	USD	670	530,975	0.46

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)						
Schatzanweisung der Vereinigten Staaten	0.13%	15/01/24	USD	2,191	2,186,975	1.89
					5,415,858	4.69
ANLEIHEN INSGESAMT					62,734,317	54.36
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt					62,734,317	54.36
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
ÖSTERREICH						
Suzano Austria GmbH	7.00%	16/03/47	USD	485	511,190	0.44
BRITISCHE JUNGFERNINSELN						
JMH Co Ltd	2.50%	09/04/31	USD	1,196	1,013,676	0.88
KANADA						
St Marys Cement Inc Canada	5.75%	28/01/27	USD	382	385,522	0.33
KAIMANINSELN						
HPHT Finance 21 Ltd	2.00%	19/03/26	USD	628	588,357	0.51
Sands China Ltd	2.55%	08/03/27	USD	1,269	1,153,799	1.00
					1,742,156	1.51
CHILE						
CAP SA	3.90%	27/04/31	USD	646	497,507	0.43
Celulosa Arauco y Constitucion SA	4.20%	29/01/30	USD	904	832,386	0.72
Cencosud SA	5.15%	12/02/25	USD	277	274,447	0.24
Cencosud SA	4.38%	17/07/27	USD	1,221	1,174,449	1.02
Inversiones CMPC SA	3.00%	06/04/31	USD	650	554,531	0.48
Inversiones CMPC SA	6.13%	23/06/33	USD	540	560,756	0.49
Sociedad de Transmision Austral SA	4.00%	27/01/32	USD	892	790,814	0.68
Telefonica Moviles Chile SA	3.54%	18/11/31	USD	1,057	785,814	0.68
					5,470,704	4.74
KOLUMBIEN						
Ecopetrol SA	8.63%	19/01/29	USD	610	652,414	0.56
Interconexion Electrica SA ESP	3.83%	26/11/33	USD	644	543,916	0.47
SURA Asset Management SA	4.88%	17/04/24	USD	962	955,848	0.83
SURA Asset Management SA	4.38%	11/04/27	USD	441	422,904	0.37
					2,575,082	2.23
HONGKONG						
Huaxin Cement International Finance Co Ltd	2.25%	19/11/25	USD	1,002	922,697	0.80
INDONESIEN						
Bank Mandiri Persero Tbk PT	4.75%	13/05/25	USD	725	720,129	0.62
Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	3.40%	09/06/31	USD	700	607,141	0.53

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
INDONESIEN (Fortsetzung)						
Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	3.54%	27/04/32	USD	666	576,922	0.50
					<u>1,904,192</u>	<u>1.65</u>
ISRAEL						
Bank Leumi Le-Israel BM 144A	5.13%	27/07/27	USD	1,064	1,048,372	0.91
Bank Leumi Le-Israel BM 144A, VRB	3.28%	29/01/31	USD	435	394,151	0.34
Mizrahi Tefahot Bank Ltd 144A, VRB	3.08%	07/04/31	USD	1,148	1,018,850	0.88
					<u>2,461,373</u>	<u>2.13</u>
JERSEY						
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd	1.75%	30/09/27	USD	833	784,413	0.68
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd	2.16%	31/03/34	USD	1,002	872,818	0.76
					<u>1,657,231</u>	<u>1.44</u>
LUXEMBURG						
Aegea Finance Sarl	9.00%	20/01/31	USD	610	651,846	0.56
MAURITIUS						
UPL Corp Ltd	4.50%	08/03/28	USD	356	315,060	0.27
UPL Corp Ltd	4.63%	16/06/30	USD	200	168,531	0.15
					<u>483,591</u>	<u>0.42</u>
MEXIKO						
Alfa SAB de CV	6.88%	25/03/44	USD	511	509,483	0.44
Alpek SAB de CV	4.25%	18/09/29	USD	411	380,047	0.33
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand	5.38%	17/04/25	USD	1,351	1,345,704	1.17
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand, VRB	7.53%	01/10/28	USD	676	708,752	0.61
BBVA Bancomer SA/Texas, VRB	5.88%	13/09/34	USD	753	705,964	0.61
BBVA Bancomer SA/Texas, VRB	8.45%	29/06/38	USD	320	340,368	0.30
Becle SAB de CV	2.50%	14/10/31	USD	1,352	1,088,571	0.94
Cemex SAB de CV, VRB	5.13%	31/12/49†	USD	575	546,448	0.47
Cibanco SA Ibm / PLA Administradora Industrial S de RL de CV	4.96%	18/07/29	USD	1,048	997,074	0.86
Infraestructura Energetica Nova SAPI de CV	4.75%	15/01/51	USD	992	771,280	0.67
Minera Mexico SA de CV	4.50%	26/01/50	USD	557	447,167	0.39
Sitios Latinoamerica SAB de CV	5.38%	04/04/32	USD	914	848,996	0.74
					<u>8,689,854</u>	<u>7.53</u>
MULTINATIONAL						
JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co. / JBS USA Finance, Inc.	5.75%	01/04/33	USD	768	761,460	0.66
NIEDERLANDE						
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	31/01/30	USD	374	289,925	0.25

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
NIEDERLANDE (Fortsetzung)						
Embraer Netherlands Finance BV	7.00%	28/07/30	USD	820	860,446	0.75
					<u>1,150,371</u>	<u>1.00</u>
PANAMA						
AES Panama Generation Holdings SRL	4.38%	31/05/30	USD	1,279	1,077,294	0.93
Banco General SA	4.13%	07/08/27	USD	1,033	969,729	0.84
					<u>2,047,023</u>	<u>1.77</u>
PARAGUAY						
Banco Continental SAECA	2.75%	10/12/25	USD	1,242	1,162,717	1.01
PERU						
Banco de Credito del Peru SA	2.70%	11/01/25	USD	633	614,080	0.53
Banco de Credito del Peru SA, VRB	3.13%	01/07/30	USD	1,900	1,800,526	1.56
Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru	8.55%	18/09/33	USD	529	574,245	0.50
InRetail Consumer	3.25%	22/03/28	USD	906	810,445	0.70
					<u>3,799,296</u>	<u>3.29</u>
PHILIPPINEN						
Philippinische internationale Staatsanleihe	5.50%	17/01/48	USD	320	337,400	0.29
SINGAPUR						
Continuum Energy Levanter Pte Ltd	4.50%	09/02/27	USD	397	375,289	0.32
					<u>375,289</u>	<u>0.32</u>
SÜDKOREA						
Korea Electric Power Corp	5.38%	31/07/26	USD	1,570	1,586,940	1.38
LG Energy Solution Ltd	5.63%	25/09/26	USD	1,140	1,152,454	1.00
LG Energy Solution Ltd	5.75%	25/09/28	USD	700	719,639	0.62
POSCO	5.75%	17/01/28	USD	260	266,456	0.23
					<u>3,725,489</u>	<u>3.23</u>
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Fresnillo Plc	4.25%	02/10/50	USD	1,956	1,495,423	1.30
VEREINIGTE STAATEN						
BOC Aviation USA Corp	4.88%	03/05/33	USD	410	401,107	0.35
ANLEIHEN INSGESAMT						
					<u>43,724,689</u>	<u>37.88</u>
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt						
					<u>43,724,689</u>	<u>37.88</u>

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Anlagen insgesamt <i>(Kosten USD 112,478,546)</i>	106,459,006	92.24
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten	8,955,771	7.76
Nettovermögen insgesamt	115,414,777	100.00

Glossar:

VRB - Variable Rate Bond (variabel verzinsliche Anleihe)

† Unbefristete Laufzeit

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.
Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.
Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
ÖSTERREICH						
A1 Towers Holding GmbH	5.25%	13/07/28	EUR	2,100	2,225,706	0.27
TSCHECHISCHE REPUBLIK						
EPH Financing International AS	6.65%	13/11/28	EUR	2,703	2,754,242	0.33
DÄNEMARK						
Danske Bank, VRB	4.75%	21/06/30	EUR	3,250	3,430,572	0.42
Orsted AS	3.63%	01/03/26	EUR	5,420	5,446,752	0.66
TDC Net	5.62%	06/02/30	EUR	4,796	4,947,241	0.60
Vestas Wind Systems	4.13%	15/06/31	EUR	6,160	6,362,864	0.77
					20,187,429	2.45
ESTLAND						
Estonische internationale Staatsanleihe	4.00%	12/10/32	EUR	2,593	2,795,191	0.34
FINNLAND						
Fortum Oyj	4.50%	26/05/33	EUR	3,622	3,847,875	0.47
Nordea Bank Abp, VRB	3.63%	10/02/26	EUR	5,516	5,502,953	0.67
					9,350,828	1.14
FRANKREICH						
Atos SE	1.00%	12/11/29	EUR	3,600	1,966,549	0.24
Banque Federative du Credit Mutuel SA	4.38%	02/05/30	EUR	6,300	6,553,310	0.80
Banque Federative du Credit Mutuel SA	4.75%	10/11/31	EUR	4,800	5,099,469	0.62
BNP Paribas SA	1.38%	28/05/29	EUR	12,200	10,990,247	1.33
BNP Paribas SA, VRB	9.25%	31/12/49†	USD	2,623	2,540,299	0.31
BNP Paribas SA, VRB	4.75%	13/11/32	EUR	7,500	7,965,387	0.97
BNP Paribas SA 144A, VRB	7.75%	31/12/49†	USD	3,336	3,092,824	0.38
BPCE SA	4.50%	13/01/33	EUR	10,800	11,370,755	1.38
BPCE SA, VRB	4.75%	14/06/34	EUR	2,900	3,088,664	0.37
Credit Agricole SA	3.88%	20/04/31	EUR	3,800	3,932,364	0.48
Credit Agricole SA	4.38%	27/11/33	EUR	3,200	3,363,824	0.41
Electricite de France SA	4.63%	25/01/43	EUR	6,300	6,652,176	0.81
Electricite de France SA, VRB	7.50%	31/12/49†	EUR	5,200	5,693,452	0.69
Electricite de France SA, VRB	9.13%	31/12/49†	USD	1,980	2,001,281	0.24
Electricite de France SA, VRB	3.38%	31/12/49†	EUR	2,200	1,932,902	0.23
Electricite de France SA, VRB	4.00%	31/12/49†	EUR	2,900	2,881,649	0.35
Electricite de France SA, VRB	5.00%	31/12/49†	EUR	5,900	5,899,964	0.72
Engie SA	4.25%	06/09/34	EUR	4,100	4,353,935	0.53
Engie SA	4.50%	06/09/42	EUR	2,800	3,022,708	0.37
Indigo Group SAS	4.50%	18/04/30	EUR	8,700	9,052,843	1.10
LAGardere SA	1.75%	07/10/27	EUR	5,700	5,690,419	0.69
Societe Generale SA, VRB	7.88%	31/12/49†	EUR	4,700	4,859,596	0.59
TDF Infrastructure SASU	5.63%	21/07/28	EUR	4,100	4,311,614	0.52
TotalEnergies SE, VRB	2.63%	31/12/49†	EUR	4,098	4,012,030	0.49
					120,328,261	14.62
DEUTSCHLAND						
Bayer AG	4.25%	26/08/29	EUR	2,106	2,184,988	0.27
Bayer AG	4.63%	26/05/33	EUR	2,111	2,207,679	0.27
Bayer AG, VRB	6.63%	25/09/83	EUR	3,200	3,265,033	0.40
Bayer AG, VRB	7.00%	25/09/83	EUR	2,900	3,001,034	0.36
Bundesobligation	2.20%	13/04/28	EUR	611	616,394	0.07
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.00%	15/08/29	EUR	485	437,097	0.05

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
DEUTSCHLAND (Fortsetzung)						
Bundesrepublik Deutschland						
Bundesanleihe	1.70%	15/08/32	EUR	1,162	1,138,151	0.14
Commerzbank AG, VRB	6.13%	31/12/49†	EUR	3,200	3,100,720	0.38
Commerzbank AG, VRB	6.50%	31/12/49†	EUR	2,400	2,284,037	0.28
Deutsche Bank AG, VRB	10.00%	31/12/49†	EUR	2,400	2,623,013	0.32
Deutsche Bank AG, VRB	1.75%	19/11/30	EUR	6,100	5,311,355	0.64
					26,169,501	3.18
GRIECHENLAND						
Griechische Staatsanleihe 144A	4.25%	15/06/33	EUR	3,652	4,005,729	0.49
Griechische Staatsanleihe 144A	4.38%	18/07/38	EUR	14,850	16,327,467	1.98
					20,333,196	2.47
ISLAND						
Iceland Rikisbref	4.50%	17/02/42	ISK	2,503,485	13,202,118	1.60
ISRAEL						
Israelische internationale Staatsanleihe	0.63%	18/01/32	EUR	15,086	11,673,439	1.42
ITALIEN						
ASTM SpA	1.50%	25/01/30	EUR	3,319	2,893,408	0.35
Autostrade per l'Italia SpA	2.00%	04/12/28	EUR	4,223	3,888,050	0.47
Autostrade per l'Italia SpA	2.00%	15/01/30	EUR	6,451	5,734,129	0.70
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	9.13%	31/12/49†	EUR	3,030	3,339,778	0.41
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	5.88%	31/12/49†	EUR	506	457,837	0.05
					16,313,202	1.98
JAPAN						
East Japan Railway Co	4.11%	22/02/43	EUR	2,892	3,064,576	0.37
LUXEMBURG						
Eurofins Scientific SE	4.75%	06/09/30	EUR	2,964	3,126,233	0.38
Eurofins Scientific SE, VRB	6.75%	31/12/49†	EUR	3,789	3,945,852	0.48
					7,072,085	0.86
MEXIKO						
Mexikanische Anleihen	5.50%	04/03/27	MXN	891,800	42,662,825	5.18
Mexikanische Anleihen	8.50%	01/03/29	MXN	131,860	6,887,027	0.84
Mexikanische Anleihen	8.50%	31/05/29	MXN	133,650	7,012,756	0.85
Mexikanische Anleihen	7.75%	29/05/31	MXN	175,960	8,805,304	1.07
Mexikanische Anleihen	7.50%	26/05/33	MXN	152,100	7,390,024	0.90
Mexikanische internationale Staatsanleihe	4.00%	15/03/15^	EUR	25,229	19,572,070	2.38
					92,330,006	11.22
NIEDERLANDE						
Abertis Infraestructuras Finance BV, VRB	3.25%	31/12/49†	EUR	2,800	2,693,118	0.33
American Medical Systems Europe BV	0.75%	08/03/25	EUR	10,493	10,146,394	1.23
Cooperatieve Rabobank UA, VRB	4.88%	31/12/49†	EUR	1,600	1,448,014	0.18
ING Groep NV, VRB	4.75%	23/05/34	EUR	6,700	7,140,765	0.87
JAB Holdings BV	5.00%	12/06/33	EUR	6,300	6,801,853	0.83

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
NIEDERLANDE (Fortsetzung)						
Prosus NV	1.29%	13/07/29	EUR	2,892	2,353,675	0.29
Prosus NV	1.99%	13/07/33	EUR	3,475	2,576,116	0.31
Sartorius Finance BV	4.25%	14/09/26	EUR	8,800	9,002,908	1.09
Telefonica Europe BV, VRB	2.38%	31/12/49†	EUR	1,000	870,694	0.10
Upjohn Finance BV	1.91%	23/06/32	EUR	5,522	4,650,129	0.56
Wintershall Dea Finance 2 BV, VRB	2.50%	31/12/49†	EUR	3,600	3,283,189	0.40
Wintershall Dea Finance 2 BV, VRB	3.00%	31/12/49†	EUR	4,900	4,291,097	0.52
Wintershall Dea Finance BV	1.33%	25/09/28	EUR	4,800	4,302,084	0.52
Wintershall Dea Finance BV	1.82%	25/09/31	EUR	1,800	1,553,396	0.19
					61,113,432	7.42
NORWEGEN						
Variable Energi ASA, VRB	7.86%	15/11/83	EUR	4,570	4,874,366	0.59
RUMÄNIEN						
Rumänische internationale Staatsanleihe	6.63%	17/02/28	USD	2,680	2,514,759	0.31
Rumänische internationale Staatsanleihe	1.75%	13/07/30	EUR	5,148	4,175,095	0.51
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.12%	16/07/31	EUR	3,623	2,895,763	0.35
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.00%	28/01/32	EUR	2,300	1,784,976	0.22
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.00%	14/04/33	EUR	5,186	3,893,102	0.47
Rumänische internationale Staatsanleihe	3.88%	29/10/35	EUR	1,075	918,429	0.11
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.63%	02/12/40	EUR	12,785	8,631,118	1.05
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.75%	14/04/41	EUR	6,419	4,324,545	0.53
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.88%	13/04/42	EUR	9,511	6,459,528	0.78
Rumänische internationale Staatsanleihe	4.63%	03/04/49	EUR	3,360	2,830,014	0.34
Rumänische internationale Staatsanleihe	3.38%	28/01/50	EUR	3,106	2,124,335	0.26
					40,551,664	4.93
SÜDAFRIKA						
Südafrikanische Staatsanleihe	8.88%	28/02/35	ZAR	290,261	12,130,034	1.47
Südafrikanische Staatsanleihe	8.50%	31/01/37	ZAR	227,423	8,784,968	1.07
					20,915,002	2.54
SPANIEN						
Banco de Sabadell SA, VRB	5.75%	31/12/49†	EUR	4,800	4,563,365	0.55
Banco Santander SA	4.88%	18/10/31	EUR	6,300	6,717,602	0.82
CaixaBank SA	4.38%	29/11/33	EUR	4,100	4,313,955	0.52
CaixaBank SA, VRB	5.88%	31/12/49†	EUR	3,000	2,912,589	0.35
Werfen SA/Spanien	4.63%	06/06/28	EUR	2,300	2,346,934	0.29
					20,854,445	2.53

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
SCHWEDEN						
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, VRB	2.62%	31/12/49†	EUR	680	111,510	0.01
SCHWEIZ						
UBS Group AG, VRB	3.25%	02/04/26	EUR	9,493	9,411,557	1.15
UBS Group AG, VRB	7.75%	01/03/29	EUR	2,990	3,449,374	0.42
UBS Group AG, VRB	2.88%	02/04/32	EUR	10,759	10,069,008	1.22
					22,929,939	2.79
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Barclays Plc, VRB	9.25%	31/12/49†	GBP	2,630	3,031,500	0.37
Barclays Plc, VRB	8.41%	14/11/32	GBP	1,984	2,444,805	0.30
Barclays Plc, VRB	5.26%	29/01/34	EUR	6,092	6,536,831	0.79
Barclays Plc, VRB	6.38%	31/12/49†	GBP	4,328	4,766,351	0.58
HSBC Holdings Plc, VRB	4.79%	10/03/32	EUR	2,980	3,157,558	0.38
HSBC Holdings Plc, VRB	6.80%	14/09/31	GBP	5,910	7,366,843	0.90
HSBC Holdings Plc, VRB	4.86%	23/05/33	EUR	6,000	6,375,394	0.77
Nationwide Building Society, VRB	5.75%	31/12/49†	GBP	965	1,029,712	0.13
NatWest Group Plc, VRB	6.00%	31/12/49†	USD	594	522,534	0.06
Vodafone Group Plc, VRB	8.00%	30/08/86	GBP	4,483	5,532,214	0.67
					40,763,742	4.95
VEREINIGTE STAATEN						
AT&T Inc	3.55%	18/11/25	EUR	10,382	10,443,263	1.27
AT&T Inc	3.95%	30/04/31	EUR	742	770,939	0.09
AT&T Inc	4.30%	18/11/34	EUR	929	983,171	0.12
Bank of America Corp, FRB	4.92%	22/09/26	EUR	9,715	9,763,177	1.19
DAE Funding LLC	1.55%	01/08/24	USD	8,425	7,438,759	0.90
Global Payments Inc	4.88%	17/03/31	EUR	6,229	6,550,506	0.80
Morgan Stanley, VRB	2.95%	07/05/32	EUR	5,796	5,492,521	0.67
National Grid North America Inc	4.67%	12/09/33	EUR	8,486	9,071,629	1.10
Tapestry Inc	7.70%	27/11/30	USD	2,993	2,858,163	0.35
Tapestry Inc	7.85%	27/11/33	USD	2,780	2,688,702	0.33
Utah Acquisition Sub Inc	2.25%	22/11/24	EUR	5,139	5,051,627	0.61
Utah Acquisition Sub Inc	3.13%	22/11/28	EUR	687	669,819	0.08
Visa Inc	1.50%	15/06/26	EUR	14,732	14,245,670	1.73
					76,027,946	9.24
ANLEIHEN INSGESAMT					635,941,826	77.25
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt					635,941,826	77.25
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
KANADA						
Enbridge Inc, VRB	8.50%	15/01/84	USD	3,970	3,824,701	0.47
KAIMANINSELN						
Avolon Holdings Funding Ltd 144A	2.13%	21/02/26	USD	11,097	9,318,824	1.13
Avolon Holdings Funding Ltd 144A	4.25%	15/04/26	USD	5,651	4,949,923	0.60
					14,268,747	1.73
FRANKREICH						
Electricite de France SA 144A	6.90%	23/05/53	USD	2,570	2,642,882	0.32

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
FRANKREICH (Fortsetzung)						
Societe Generale SA, VRB	9.38%	31/12/49†	USD	2,577	2,439,667	0.30
					5,082,549	0.62
DEUTSCHLAND						
Robert Bosch GmbH	4.00%	02/06/35	EUR	3,900	4,139,546	0.50
Robert Bosch GmbH	4.38%	02/06/43	EUR	4,600	4,947,737	0.60
					9,087,283	1.10
ITALIEN						
Intesa Sanpaolo SpA	5.13%	29/08/31	EUR	4,150	4,433,603	0.54
Intesa Sanpaolo SpA	5.63%	08/03/33	EUR	5,400	5,824,218	0.71
Intesa Sanpaolo SpA 144A, VRB	8.25%	21/11/33	USD	5,283	5,208,632	0.63
					15,466,453	1.88
JAPAN						
East Japan Railway Co	4.39%	05/09/43	EUR	788	857,776	0.10
Nissan Motor Co Ltd 144A	4.81%	17/09/30	USD	2,905	2,462,406	0.30
					3,320,182	0.40
LUXEMBURG						
Bevco Lux Sarl	1.00%	16/01/30	EUR	2,162	1,812,291	0.22
NIEDERLANDE						
Sartorius Finance BV	4.38%	14/09/29	EUR	3,000	3,111,894	0.38
Sartorius Finance BV	4.50%	14/09/32	EUR	2,200	2,296,099	0.28
Sartorius Finance BV	4.88%	14/09/35	EUR	2,200	2,324,614	0.28
					7,732,607	0.94
RUMÄNIEN						
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.88%	26/05/28	EUR	1,256	1,176,036	0.15
Rumänische internationale Staatsanleihe	3.38%	08/02/38	EUR	1,591	1,247,844	0.15
					2,423,880	0.30
SPANIEN						
CaixaBank SA 144A, VRB	6.84%	13/09/34	USD	7,230	6,913,926	0.84
SCHWEIZ						
Credit Suisse Group AG, FTB †:#	9.75%	31/12/49†	USD	3,540	384,556	0.05
UBS Group AG 144A, VRB	9.02%	15/11/33	USD	1,950	2,172,896	0.26
					2,557,452	0.31
VEREINIGTE STAATEN						
Amgen Inc	5.65%	02/03/53	USD	2,712	2,589,728	0.31
Amgen Inc	5.75%	02/03/63	USD	3,710	3,537,685	0.43
Bayer US Finance LLC 144A	6.50%	21/11/33	USD	4,580	4,277,141	0.52
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	3.50%	01/06/41	USD	4,070	2,610,492	0.32
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	3.85%	01/04/61	USD	3,291	1,875,947	0.23

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)						
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications						
Operating Capital	4.40%	01/12/61	USD	5,307	3,337,442	0.41
Intel Corp	5.70%	10/02/53	USD	3,800	3,728,937	0.45
Micron Technology Inc	5.88%	09/02/33	USD	4,973	4,701,786	0.57
Utah Acquisition Sub Inc	5.25%	15/06/46	USD	3,883	2,935,011	0.36
Viatrix Inc	4.00%	22/06/50	USD	1,071	684,583	0.08
Warnermedia Holdings Inc	5.05%	15/03/42	USD	2,573	2,056,267	0.25
Warnermedia Holdings Inc	5.14%	15/03/52	USD	3,573	2,786,244	0.34
Warnermedia Holdings Inc	5.39%	15/03/62	USD	3,226	2,514,070	0.30
					37,635,333	4.57
ANLEIHEN INSGESAMT					110,125,404	13.38
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt					110,125,404	13.38
Anlagen insgesamt (Kosten EUR 762,014,573)					746,067,230	90.63
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					77,155,586	9.37
Nettovermögen insgesamt					823,222,816	100.00

Glossar:

FTB - Flat Trading Bond (pauschal gehandelte Anleihe)

FRB - Floating Rate Bond (Anleihe mit variablem Zins)

VRB - Variable Rate Bond (variabel verzinsliche Anleihe)

± notleidendes Wertpapier

† Unbefristete Laufzeit

^ Fälligkeitsdatum ist der 15. März 2115

Die Investition stellt eine zum beizulegenden Zeitwert bewertete Forderung dar

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.

Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
ARGENTINIEN						
Pampa Energia SA	7.50%	24/01/27	USD	259	253,011	0.31
BERMUDA						
Investment Energy Resources Ltd	6.25%	26/04/29	USD	806	759,945	0.94
BRITISCHE JUNGFERNINSELN						
CAS Capital No 1 Ltd, VRB	4.00%	31/12/49†	USD	509	440,683	0.54
Studio City Finance Ltd	6.50%	15/01/28	USD	284	263,765	0.33
					704,448	0.87
KAIMANINSELN						
China Evergrande Group †	11.50%	22/01/23 ^β	USD	2,007	30,105	0.04
IHS Holding Ltd	6.25%	29/11/28	USD	352	284,240	0.35
Kaisa Group Holdings Ltd, FTB †	8.50%	30/06/22 ^β	USD	226	7,345	0.01
Kaisa Group Holdings Ltd, FTB †	11.95%	22/10/22 ^β	USD	226	7,345	0.01
Kaisa Group Holdings Ltd, FTB †	10.88%	23/07/23 ^β	USD	676	21,970	0.03
Kaisa Group Holdings Ltd †	9.75%	28/09/23 ^β	USD	200	6,500	0.01
Lamar Funding Ltd	3.96%	07/05/25	USD	439	429,017	0.53
Melco Resorts Finance Ltd	5.75%	21/07/28	USD	443	410,398	0.51
Melco Resorts Finance Ltd	5.38%	04/12/29	USD	793	700,814	0.87
MGM China Holdings Ltd	5.88%	15/05/26	USD	200	195,750	0.24
Wynn Macau Ltd	4.88%	01/10/24	USD	234	231,477	0.28
Wynn Macau Ltd	5.50%	01/10/27	USD	383	360,977	0.45
Wynn Macau Ltd	5.63%	26/08/28	USD	441	409,717	0.51
Zhenro Properties Group Ltd †	9.15%	06/05/23 ^β	USD	570	5,700	0.01
Zhenro Properties Group Ltd †	7.35%	05/02/25	USD	510	5,100	0.00
					3,106,455	3.85
KOLUMBIEN						
Bancolombia SA, VRB	4.63%	18/12/29	USD	875	810,547	1.00
Ecopetrol SA	8.88%	13/01/33	USD	976	1,061,400	1.32
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.38%	15/02/31	USD	278	228,181	0.28
					2,100,128	2.60
UNGARN						
OTP Bank Nyrt, VRB	8.75%	15/05/33	USD	320	329,600	0.41
INDIEN						
Shriram Finance Ltd	4.40%	13/03/24	USD	389	386,258	0.48
ISRAEL						
Bank Hapoalim BM 144A, VRB	3.26%	21/01/32	USD	261	226,621	0.28
Bank Leumi Le-Israel BM 144A, VRB	7.13%	18/07/33	USD	250	246,875	0.31
Leviathan Bond Ltd 144A	6.50%	30/06/27	USD	944	891,564	1.10
Leviathan Bond Ltd 144A	6.75%	30/06/30	USD	63	57,820	0.07
					1,422,880	1.76
JERSEY						
West China Cement Ltd	4.95%	08/07/26	USD	96	70,185	0.09
LUXEMBURG						
Aegea Finance Sarl	6.75%	20/05/29	USD	343	336,118	0.42

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
LUXEMBURG (Fortsetzung)						
Altice Financing SA	5.75%	15/08/29	USD	669	594,052	0.74
MHP Lux SA	6.95%	03/04/26	USD	337	262,860	0.32
Minerva Luxembourg SA	4.38%	18/03/31	USD	382	315,931	0.39
					1,508,961	1.87
MAURITIUS						
Axian Telecom	7.38%	16/02/27	USD	501	469,453	0.58
Greenko Power II Ltd	4.30%	13/12/28	USD	302	275,562	0.34
HTA Group Ltd/Mauritius	7.00%	18/12/25	USD	659	650,565	0.81
MTN Mauritius Investments Ltd	6.50%	13/10/26	USD	329	332,701	0.41
Network i2i Ltd, VRB	5.65%	31/12/49†	USD	601	593,018	0.74
					2,321,299	2.88
MEXIKO						
Banco Mercantil del Norte SA, VRB	7.63%	31/12/49†	USD	506	489,254	0.60
Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, VRB	6.75%	31/12/49†	USD	901	892,720	1.11
Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, VRB	8.38%	31/12/49†	USD	602	595,113	0.74
Braskem Idesa SAPI	7.45%	15/11/29	USD	300	186,660	0.23
Petroleos Mexicanos	6.75%	21/09/47	USD	465	305,389	0.38
					2,469,136	3.06
MULTINATIONAL						
GEMS MENASA Cayman Ltd / GEMS Education Delaware LLC	7.13%	31/07/26	USD	505	497,267	0.62
NIEDERLANDE						
Braskem Netherlands Finance BV	7.25%	13/02/33	USD	566	475,440	0.59
IHS Netherlands Holdco BV	8.00%	18/09/27	USD	586	522,913	0.65
Metinvest BV	8.50%	23/04/26	USD	311	219,255	0.27
Metinvest BV	7.65%	01/10/27	USD	707	459,550	0.57
Metinvest BV	7.75%	17/10/29	USD	271	165,310	0.21
MV24 Capital BV	6.75%	01/06/34	USD	830	776,176	0.96
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	3.15%	01/10/26	USD	1,936	1,798,060	2.23
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	5.13%	09/05/29	USD	490	469,675	0.58
					4,886,379	6.06
NIGERIA						
United Bank for Africa Plc	6.75%	19/11/26	USD	719	665,075	0.83
OMAN						
Bank Muscat SAOG	4.75%	17/03/26	USD	664	650,355	0.81
OQ SAOC	5.13%	06/05/28	USD	243	240,912	0.30
					891,267	1.11
PHILIPPINEN						
SMC Global Power Holdings Corp, VRB	6.50%	31/12/49†	USD	697	665,635	0.83

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
KATAR						
Commercial Bank PSQC, VRB	4.50%	31/12/49†	USD	608	557,175	0.69
THAILAND						
Bangkok Bank PCL/Hong Kong, VRB	3.47%	23/09/36	USD	780	654,490	0.81
TÜRKEI						
Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği AS	8.25%	15/11/28	USD	610	638,914	0.79
QNB Finansbank AS, VRB	10.75%	15/11/33	USD	470	512,300	0.64
Türk Telekomünikasyon AS	6.88%	28/02/25	USD	335	332,488	0.41
Turkcell İletişim Hizmetleri AS	5.75%	15/10/25	USD	331	326,654	0.40
Turkcell İletişim Hizmetleri AS	5.80%	11/04/28	USD	331	314,191	0.39
Türkische internationale Staatsanleihe	4.88%	16/04/43	USD	1,083	794,029	0.98
Türkische internationale Staatsanleihe	5.75%	11/05/47	USD	1,243	974,201	1.21
Türkiye İhracat Kredi Bankası AS	9.00%	28/01/27	USD	340	354,928	0.44
Türkiye Vakıflar Bankası Tao	9.00%	12/10/28	USD	564	593,258	0.74
Ziraat Katılım Varlık Kiralama AS	9.38%	12/11/26	USD	680	717,506	0.89
					5,558,469	6.89
UKRAINE						
Ukrainische internationale Staatsanleihe, FTB *	7.75%	01/09/26	USD	326	91,443	0.11
Ukrainische internationale Staatsanleihe, FTB *	7.75%	01/09/28	USD	312	88,062	0.11
Ukrainische internationale Staatsanleihe, FTB *	7.38%	25/09/34	USD	1,146	273,608	0.34
Ukrainische internationale Staatsanleihe, FRB*	7.75%	01/08/41	USD	653	294,039	0.37
VF Ukraine PAT via VFU Funding Plc	6.20%	11/02/25	USD	272	211,480	0.26
					958,632	1.19
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE						
Emirates NBD Bank PJSC, VRB	6.13%	31/12/49†	USD	1,099	1,096,252	1.36
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Bidvest Group UK Plc	3.63%	23/09/26	USD	749	696,453	0.86
Tullow Oil Plc	10.25%	15/05/26	USD	403	360,244	0.45
Ukreximbank Via Biz Finance Plc, VRB	9.95%	14/11/29	USD	208	146,506	0.18
Vedanta Resources Finance II Plc	8.95%	11/03/25	USD	333	249,818	0.31
					1,453,021	1.80
VEREINIGTE STAATEN						
Kosmos Energy Ltd	7.50%	01/03/28	USD	738	677,115	0.84
Stillwater Mining Co	4.00%	16/11/26	USD	812	722,680	0.89
Stillwater Mining Co	4.50%	16/11/29	USD	1,261	999,342	1.24
					2,399,137	2.97
ANLEIHEN INSGESAMT						
					35,715,105	44.28

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
STAMMAKTIE						
MEXIKO						
Urbi Desarrollos Urbanos SAB de CV			MXN	10	3,896	0.00
STAMMAKTIE INSGESAMT					3,896	0.00
KURZFRISTIGE ANLEIHEN						
KAIMANINSELN						
Zhenro Properties Group Ltd †	8.00%	06/03/23 ^β	USD	200	2,500	0.00
KURZFRISTIGE ANLEIHEN INSGESAMT					2,500	0.00
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt					35,721,501	44.28
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
ARGENTINIEN						
Argentinische internationale Staatsanleihe, S/U	4.25%	09/01/38	USD	2,966	1,178,960	1.46
YPF SA	8.75%	04/04/24	USD	396	393,197	0.49
YPF SA	8.50%	23/03/25	USD	348	336,309	0.42
YPF SA	6.95%	21/07/27	USD	220	196,030	0.24
YPF SA, S/U	9.00%	12/02/26	USD	390	396,761	0.49
					2,501,257	3.10
ÖSTERREICH						
Klabn Austria GmbH	3.20%	12/01/31	USD	488	406,565	0.50
BERMUDA						
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd	3.25%	15/08/30	USD	811	668,821	0.83
BRASILIE						
Banco do Brasil SA/Cayman	6.25%	18/04/30	USD	485	504,982	0.63
Samarco Mineracao SA, PIK	9.50%	30/06/31	USD	3,076	2,581,513	3.20
					3,086,495	3.83
BRITISCHE JUNGFERNINSELN						
Studio City Co Ltd	7.00%	15/02/27	USD	386	380,873	0.47
Studio City Finance Ltd	5.00%	15/01/29	USD	381	320,338	0.40
					701,211	0.87
KANADA						
Canacol Energy Ltd	5.75%	24/11/28	USD	579	424,404	0.53
First Quantum Minerals Ltd	6.88%	01/03/26	USD	634	571,621	0.71
First Quantum Minerals Ltd	6.88%	15/10/27	USD	988	843,569	1.04
					1,839,594	2.28
KAIMANINSELN						
China Evergrande Group †	8.75%	28/06/25	USD	831	12,465	0.01
Kaisa Group Holdings Ltd, FTB †	10.88%	31/12/49†	USD	206	5,150	0.01
Kaisa Group Holdings Ltd, FTB †	11.50%	30/01/23 ^β	USD	200	6,500	0.01
Kaisa Group Holdings Ltd †	9.38%	30/06/24	USD	462	15,015	0.02

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
KAIMANINSELN (Fortsetzung)						
Kaisa Group Holdings Ltd, FTB †	10.50%	15/01/25	USD	215	6,988	0.01
Melco Resorts Finance Ltd	5.63%	17/07/27	USD	486	458,435	0.57
MGM China Holdings Ltd	5.38%	15/05/24	USD	180	179,555	0.22
MGM China Holdings Ltd	4.75%	01/02/27	USD	852	812,462	1.01
Oryx Funding Ltd	5.80%	03/02/31	USD	1,161	1,170,166	1.45
Seazen Group Ltd	4.45%	13/07/25	USD	200	64,000	0.08
Wynn Macau Ltd	5.13%	15/12/29	USD	1,156	1,028,298	1.27
Zhenro Properties Group Ltd †	6.63%	07/01/26	USD	280	2,800	0.00
Zhenro Properties Group Ltd †	6.70%	04/08/26	USD	2,387	23,870	0.03
					3,785,704	4.69
CHILE						
AES Andes SA, VRB	7.13%	26/03/79	USD	554	528,204	0.66
Agrosuper SA	4.60%	20/01/32	USD	188	162,568	0.20
Latam Airlines Group SA	13.38%	15/10/27	USD	60	66,966	0.08
					757,738	0.94
KOLUMBIEN						
Ecopetrol SA	5.88%	28/05/45	USD	1,833	1,446,237	1.79
Grupo Energia Bogota SA ESP	7.85%	09/11/33	USD	200	217,720	0.27
					1,663,957	2.06
GUATEMALA						
CT Trust	5.13%	03/02/32	USD	724	632,483	0.79
INDIEN						
ReNew Wind Energy AP2 / ReNew Power Pvt Ltd / sonstige 9 Tochtergesellschaften	4.50%	14/07/28	USD	232	207,176	0.26
IRLAND						
C&W Senior Financing DAC	6.88%	15/09/27	USD	362	339,192	0.42
ISRAEL						
Enegean Israel Finance Ltd 144A	8.50%	30/09/33	USD	597	570,411	0.71
LUXEMBURG						
Aegea Finance Sarl	9.00%	20/01/31	USD	540	577,044	0.72
Millicom International Cellular SA	5.13%	15/01/28	USD	461	430,680	0.53
Millicom International Cellular SA	6.25%	25/03/29	USD	462	439,760	0.55
Millicom International Cellular SA	4.50%	27/04/31	USD	350	292,162	0.36
Minerva Luxembourg SA	8.88%	13/09/33	USD	430	456,922	0.57
Rede D'or Finance Sarl	4.95%	17/01/28	USD	221	210,893	0.26
Rede D'or Finance Sarl	4.50%	22/01/30	USD	48	43,016	0.05
					2,450,477	3.04
MEXIKO						
BBVA Bancomer SA/Texas, VRB	5.88%	13/09/34	USD	663	621,586	0.77
BBVA Bancomer SA/Texas, VRB	8.45%	29/06/38	USD	460	489,279	0.61
Braskem Idesa SAPI	6.99%	20/02/32	USD	520	297,414	0.37
Cemex SAB de CV, VRB	9.13%	31/12/49†	USD	240	255,720	0.32
Cemex SAB de CV, VRB	5.13%	31/12/49†	USD	674	640,533	0.79
Electricidad Firme de Mexico Holdings SA de CV	4.90%	20/11/26	USD	722	650,110	0.80
Grupo Aeromexico SAB de CV	8.50%	17/03/27	USD	200	195,219	0.24

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
MEXIKO (Fortsetzung)						
Petroleos Mexicanos	6.95%	28/01/60	USD	1,929	1,273,140	1.58
					<u>4,423,001</u>	<u>5.48</u>
NIEDERLANDE						
Braskem Netherlands Finance BV, VRB	8.50%	23/01/81	USD	648	567,000	0.70
Embraer Netherlands Finance BV	7.00%	28/07/30	USD	590	619,102	0.77
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	7.88%	15/09/29	USD	200	215,974	0.27
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	8.13%	15/09/31	USD	200	218,370	0.27
					<u>1,620,446</u>	<u>2.01</u>
PARAGUAY						
Telefonica Celular del Paraguay SA	5.88%	15/04/27	USD	1,151	1,128,147	1.40
PERU						
Compania de Minas Buenaventura SAA	5.50%	23/07/26	USD	372	357,228	0.44
Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru	8.55%	18/09/33	USD	432	468,949	0.58
InRetail Consumer	3.25%	22/03/28	USD	378	338,133	0.42
					<u>1,164,310</u>	<u>1.44</u>
SINGAPUR						
Continuum Energy Levanter Pte Ltd	4.50%	09/02/27	USD	381	360,952	0.45
Medco Bell Pte Ltd	6.38%	30/01/27	USD	450	433,125	0.54
Medco Maple Tree Pte Ltd	8.96%	27/04/29	USD	910	930,475	1.15
					<u>1,724,552</u>	<u>2.14</u>
SPANIEN						
AI Candelaria Spain SA	5.75%	15/06/33	USD	607	470,637	0.58
TÜRKEI						
Limak Iskenderun Uluslararası Liman İşletmeciliği AS	9.50%	10/07/36	USD	440	403,195	0.50
Ulker Bisküvi Sanayi AS	6.95%	30/10/25	USD	287	282,606	0.35
					<u>685,801</u>	<u>0.85</u>
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Avianca Midco 2 Plc	9.00%	01/12/28	USD	1,060	932,589	1.16
Endeavour Mining Plc	5.00%	14/10/26	USD	577	534,987	0.66
WE Soda Investments Holding Plc	9.50%	06/10/28	USD	450	467,212	0.58
					<u>1,934,788</u>	<u>2.40</u>
VEREINIGTE STAATEN						
Azul Secured Finance LLP	11.93%	28/08/28	USD	350	362,852	0.45
NBM US Holdings Inc	7.00%	14/05/26	USD	375	379,575	0.47
SierraCol Energy Andina LLC	6.00%	15/06/28	USD	607	508,496	0.63
					<u>1,250,923</u>	<u>1.55</u>
ANLEIHEN INSGESAMT					34,013,686	42.17

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)						
SierraCol Energy Andina LLC	6.00%	15/06/28	USD	607	508,496	0.63
					1,250,923	1.55
ANLEIHEN INSGESAMT					34,013,686	42.17
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt					34,013,686	42.17
Sonstige Wertpapiere						
ANLEIHEN						
BERMUDA						
Digicel Group Holdings Ltd [±]	0.00%	31/12/30	USD	142	78,036	0.10
Digicel Group Holdings Ltd [±]	0.00%	31/12/30	USD	426	31,959	0.04
Digicel Group Holdings Ltd [±]	0.00%	31/12/30	USD	2	1,292	0.00
					111,287	0.14
MULTINATIONAL						
Digicel International Finance Ltd/Digicel international Holdings Ltd	8.75%	25/05/24	USD	1,067	1,000,330	1.24
ANLEIHEN INSGESAMT					1,111,617	1.38
STAMMAKTIEN						
LUXEMBURG						
Drillco Holding Lux SA			USD	7	178,400	0.22
Drillco Holding Lux SA			USD	1	19,800	0.03
					198,200	0.25
STAMMAKTIEN INSGESAMT					198,200	0.25
OPTIONSSCHEINE						
MEXIKO						
Urbi Warrant			MXN	109	0	0.00
OPTIONSSCHEINE INSGESAMT					0	0.00
Sonstige Wertpapiere insgesamt					1,309,817	1.63

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Anlagen insgesamt <i>(Kosten USD 79,716,622)</i>	71,045,004	88.08
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten	9,619,404	11.92
Nettovermögen insgesamt	80,664,408	100.00

Glossar:

FTB - Flat Trading Bond (pauschal gehandelte Anleihe)

FRB - Floating Rate Bond (Anleihe mit variablem Zins)

PIK - Payment-in-Kind (Sachleistung)

S/U - Step Up Bond

VRB - Variable Rate Bond (variabel verzinsliche Anleihe)

± notleidendes Wertpapier

† Unbefristete Laufzeit

β Die Anlage stellt ein offenstehendes Geschäft nach dem Fälligkeitsdatum dar

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.

Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
ÖSTERREICH						
Suzano Austria GmbH	3.13%	15/01/32	USD	7,664	6,355,446	0.30
KANADA						
Enbridge Inc	5.97%	08/03/26	USD	9,460	9,470,662	0.44
TransCanada PipeLines Ltd	6.20%	09/03/26	USD	5,710	5,709,790	0.26
					15,180,452	0.70
CHILE						
Corp. Nacional del Cobre de Chile	6.30%	08/09/53	USD	7,500	7,604,958	0.35
DÄNEMARK						
TDC Net	5.62%	06/02/30	EUR	9,057	10,320,316	0.48
FRANKREICH						
Banque Federative du Credit						
Mutuel SA	4.75%	10/11/31	EUR	10,600	12,439,826	0.58
BNP Paribas SA, VRB	4.75%	13/11/32	EUR	15,800	18,536,485	0.86
BPCE SA	4.50%	13/01/33	EUR	7,300	8,490,106	0.39
Credit Agricole SA	4.38%	27/11/33	EUR	7,800	9,057,379	0.42
Electricite de France SA, VRB	7.50%	31/12/49†	EUR	8,400	10,159,593	0.47
Electricite de France SA, VRB	9.13%	31/12/49†	USD	5,360	5,984,561	0.28
Electricite de France SA, VRB	3.00%	31/12/49†	EUR	5,600	5,654,373	0.26
Electricite de France SA, VRB	3.38%	31/12/49†	EUR	10,000	9,705,366	0.45
Electricite de France SA, VRB	5.88%	31/12/49†	GBP	2,900	3,391,122	0.16
Electricite de France SA, VRB	6.00%	31/12/49†	GBP	6,000	7,465,048	0.35
Engie SA	4.25%	06/09/34	EUR	8,700	10,205,683	0.47
Engie SA	4.50%	06/09/42	EUR	6,000	7,155,074	0.33
Societe Generale SA, VRB	4.88%	21/11/31	EUR	10,600	12,259,802	0.57
					120,504,418	5.59
DEUTSCHLAND						
Bayer AG, VRB	6.63%	25/09/83	EUR	6,200	6,988,016	0.32
Bayer AG, VRB	7.00%	25/09/83	EUR	7,500	8,573,515	0.40
Bundesrepublik Deutschland						
Bundesanleihe	0.00%	15/08/26	EUR	877	917,054	0.04
Bundesrepublik Deutschland						
Bundesanleihe	0.25%	15/02/29	EUR	381	387,608	0.02
Commerzbank AG, VRB	6.13%	31/12/49†	EUR	3,800	4,067,437	0.19
Deutsche Bank AG, VRB	4.63%	31/12/49†	EUR	7,000	6,364,928	0.30
Deutsche Bank AG, VRB	6.75%	31/12/49†	EUR	6,400	6,593,117	0.31
Deutsche Bank AG, VRB	10.00%	31/12/49†	EUR	4,800	5,795,023	0.27
Deutsche Bank AG, VRB	1.75%	19/11/30	EUR	15,100	14,523,695	0.67
EnBW Energie Baden- Wuerttemberg AG, VRB	1.38%	31/08/81	EUR	1,700	1,606,450	0.07
					55,816,843	2.59
IRLAND						
AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust	4.63%	15/10/27	USD	5,324	5,231,945	0.24
ITALIEN						
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	9.13%	31/12/49†	EUR	6,970	8,486,574	0.39
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	5.50%	31/12/49†	EUR	13,176	13,529,408	0.63
					22,015,982	1.02
JAPAN						
East Japan Railway Co	4.11%	22/02/43	EUR	4,906	5,742,808	0.27

BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
JAPAN (Fortsetzung)						
Mizuho Financial Group Inc, VRB	2.65%	22/05/26	USD	9,850	9,483,813	0.44
Nomura Holdings Inc	5.61%	06/07/29	USD	5,788	5,920,137	0.27
Nomura Holdings Inc	2.61%	14/07/31	USD	9,243	7,679,528	0.36
NTT Finance Corp 144A	1.16%	03/04/26	USD	20,566	18,991,036	0.88
Renesas Electronics Corp 144A	1.54%	26/11/24	USD	8,530	8,209,801	0.38
					56,027,123	2.60
JERSEY						
Heathrow Funding Ltd	4.50%	11/07/33	EUR	11,579	13,628,478	0.63
LUXEMBURG						
Eurofins Scientific SE	4.75%	06/09/30	EUR	7,287	8,490,175	0.39
Eurofins Scientific SE, VRB	6.75%	31/12/49†	EUR	7,731	8,893,579	0.41
Simon International Finance SCA	1.13%	19/03/33	EUR	9,080	8,144,398	0.38
					25,528,152	1.18
NIEDERLANDE						
Abertis Infraestructuras Finance BV, VRB	3.25%	31/12/49†	EUR	9,500	10,093,591	0.47
EnBW International Finance BV	4.00%	24/01/35	EUR	6,858	7,833,896	0.36
Heimstadten Bostad Treasury BV	1.38%	24/07/28	EUR	12,451	9,908,591	0.46
ING Groep NV, VRB	4.75%	23/05/34	EUR	6,900	8,123,510	0.38
Telefonica Europe BV, VRB	2.38%	31/12/49†	EUR	2,100	2,019,804	0.09
Telefonica Europe BV, VRB	6.14%	31/12/49†	EUR	600	683,817	0.03
Upjohn Finance BV	1.91%	23/06/32	EUR	7,152	6,653,050	0.31
Volkswagen International Finance NV, VRB	3.88%	31/12/49†	EUR	2,000	2,111,047	0.10
Volkswagen International Finance NV, VRB	4.63%	31/12/49†	EUR	1,100	1,180,113	0.05
Wintershall Dea Finance 2 BV, VRB	2.50%	31/12/49†	EUR	9,000	9,066,936	0.42
Wintershall Dea Finance 2 BV, VRB	3.00%	31/12/49†	EUR	17,100	16,542,193	0.77
					74,216,548	3.44
NORWEGEN						
Variable Energi ASA, VRB	7.86%	15/11/83	EUR	13,435	15,829,395	0.73
SINGAPUR						
Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd	5.34%	19/05/63	USD	10,670	10,806,659	0.50
SPANIEN						
Abertis Infraestructuras SA	4.13%	07/08/29	EUR	9,600	10,905,074	0.50
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, VRB	6.00%	31/12/49†	EUR	7,000	7,721,808	0.36
Banco Santander SA	4.88%	18/10/31	EUR	9,500	11,189,792	0.52
Banco Santander SA	6.94%	07/11/33	USD	9,800	10,911,398	0.51
CaixaBank SA	4.38%	29/11/33	EUR	8,100	9,414,592	0.44
CaixaBank SA, VRB	5.00%	19/07/29	EUR	6,200	7,169,228	0.33
CaixaBank SA, VRB	5.13%	19/07/34	EUR	9,600	11,343,253	0.53
CaixaBank SA, VRB	6.75%	31/12/49†	EUR	6,400	7,074,133	0.33
EDP Servicios Financieros Espana SA	4.38%	04/04/32	EUR	7,130	8,403,733	0.39
Telefonica Emisiones SA	5.21%	08/03/47	USD	9,849	9,172,564	0.42
					93,305,575	4.33

BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
SCHWEIZ						
UBS Group AG, VRB	7.75%	01/03/29	EUR	24,096	30,707,092	1.42
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Barclays Plc, VRB	9.25%	31/12/49†	GBP	7,099	9,039,068	0.42
Barclays Plc, VRB	6.50%	13/09/27	USD	10,230	10,521,694	0.49
Barclays Plc, VRB	7.13%	31/12/49†	GBP	7,639	9,501,756	0.44
HSBC Holdings Plc, VRB	4.76%	09/06/28	USD	10,670	10,525,063	0.49
					39,587,581	1.84
VEREINIGTE STAATEN						
American Tower Corp	4.63%	16/05/31	EUR	7,239	8,437,482	0.39
AT&T Inc	3.95%	30/04/31	EUR	5,865	6,731,451	0.31
AT&T Inc	4.30%	18/11/34	EUR	9,245	10,807,995	0.50
Carrier Global Corp	4.50%	29/11/32	EUR	5,570	6,590,517	0.31
Citizens Financial Group Inc	2.50%	06/02/30	USD	5,766	4,854,738	0.22
Comerica Inc	4.00%	01/02/29	USD	7,753	7,334,475	0.34
Computershare US Inc	1.13%	07/10/31	EUR	4,281	3,709,652	0.17
Energy Transfer LP	5.75%	15/02/33	USD	6,620	6,850,987	0.32
Energy Transfer LP	6.25%	15/04/49	USD	8,535	8,865,273	0.41
Euronet Worldwide Inc	1.38%	22/05/26	EUR	4,329	4,493,881	0.21
Ford Motor Credit Co LLC	7.20%	10/06/30	USD	6,153	6,563,841	0.30
Ford Motor Credit Co LLC	7.12%	07/11/33	USD	5,940	6,405,281	0.30
General Motors Co	5.40%	01/04/48	USD	8,013	7,363,632	0.34
General Motors Financial Co Inc	2.90%	26/02/25	USD	10,280	9,982,347	0.46
Global Payments Inc	4.88%	17/03/31	EUR	12,813	14,884,424	0.69
Global Payments Inc	5.95%	15/08/52	USD	8,701	8,911,565	0.41
HCA Inc	3.50%	01/09/30	USD	7,733	7,017,128	0.33
J M Smucker Co	6.20%	15/11/33	USD	6,671	7,283,147	0.34
Jones Lang LaSalle Inc	6.88%	01/12/28	USD	5,864	6,210,038	0.29
KeyBank NA/Cleveland OH	6.95%	01/02/28	USD	6,354	6,479,964	0.30
Kinder Morgan Inc	5.30%	01/12/34	USD	13,200	13,164,646	0.61
LKQ Corp	6.25%	15/06/33	USD	9,656	10,100,457	0.47
Metropolitan Life Global Funding I	3.75%	07/12/31	EUR	9,420	10,703,946	0.50
MPLX LP	5.00%	01/03/33	USD	6,807	6,680,918	0.31
NextEra Energy Capital Holdings Inc	5.25%	28/02/53	USD	2,555	2,509,244	0.12
Oracle Corp	4.10%	25/03/61	USD	9,510	7,280,322	0.34
Ovintiv Inc	6.25%	15/07/33	USD	10,917	11,306,153	0.52
Tapestry Inc	7.00%	27/11/26	USD	10,660	11,068,587	0.51
Tapestry Inc	7.70%	27/11/30	USD	7,332	7,734,415	0.36
Tapestry Inc	7.85%	27/11/33	USD	5,360	5,726,475	0.27
Schatzanweisung der Vereinigten Staaten	5.00%	31/08/25	USD	37,900	38,258,274	1.77
VICI Properties LP	4.95%	15/02/30	USD	6,330	6,147,463	0.28
VICI Properties LP	5.13%	15/05/32	USD	6,880	6,716,236	0.31
					287,174,954	13.31
ANLEIHEN INSGESAMT					889,841,917	41.25
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt					889,841,917	41.25
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
AUSTRALIEN						
Macquarie Group Ltd 144A, VRB	6.26%	07/12/34	USD	17,050	17,845,379	0.83
Santos Finance Ltd	3.65%	29/04/31	USD	14,960	13,033,449	0.60
South32 Treasury Ltd 144A	4.35%	14/04/32	USD	5,790	5,242,377	0.24
					36,121,205	1.67

BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
BELGIEN						
KBC Group NV 144A, VRB	6.32%	21/09/34	USD	12,150	12,840,213	0.59
BERMUDA						
Aircastle Ltd 144A	2.85%	26/01/28	USD	7,533	6,719,164	0.31
Triton Container International Ltd 144A	1.15%	07/06/24	USD	8,103	7,924,889	0.37
					14,644,053	0.68
KANADA						
Bank of Nova Scotia, VRB	4.59%	04/05/37	USD	15,400	13,799,959	0.64
Canadian Imperial Bank of Commerce	6.09%	03/10/33	USD	10,100	10,787,821	0.50
Enbridge Inc, VRB	8.50%	15/01/84	USD	9,580	10,195,234	0.47
Rogers Communications Inc	4.50%	15/03/42	USD	8,245	7,296,109	0.34
Rogers Communications Inc	4.55%	15/03/52	USD	7,353	6,436,179	0.30
					48,515,302	2.25
KAIMANINSELN						
Avolon Holdings Funding Ltd 144A	4.25%	15/04/26	USD	7,701	7,451,522	0.35
Avolon Holdings Funding Ltd 144A	3.25%	15/02/27	USD	7,230	6,698,143	0.31
Avolon Holdings Funding Ltd 144A	6.38%	04/05/28	USD	10,000	10,204,662	0.47
					24,354,327	1.13
CHILE						
Empresa de los Ferrocarriles del Estado	3.83%	14/09/61	USD	4,083	2,803,743	0.13
FRANKREICH						
Electricite de France SA 144A	6.90%	23/05/53	USD	6,130	6,963,535	0.32
Societe Generale SA, VRB	9.38%	31/12/49†	USD	9,862	10,313,496	0.48
					17,277,031	0.80
DEUTSCHLAND						
Deutsche Bank AG, VRB	4.88%	01/12/32	USD	9,198	8,604,347	0.40
Robert Bosch GmbH	4.38%	02/06/43	EUR	9,600	11,406,298	0.53
					20,010,645	0.93
IRLAND						
AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust	6.45%	15/04/27	USD	12,904	13,367,517	0.62
AIB Group Plc 144A, VRB	6.61%	13/09/29	USD	6,510	6,861,140	0.32
					20,228,657	0.94
ITALIEN						
Intesa Sanpaolo SpA	5.13%	29/08/31	EUR	9,280	10,951,697	0.51
Intesa Sanpaolo SpA 144A	6.63%	20/06/33	USD	9,530	9,751,573	0.45
Intesa Sanpaolo SpA 144A, VRB	8.25%	21/11/33	USD	10,620	11,566,242	0.54
UniCredit SpA 144A, VRB	3.13%	03/06/32	USD	10,638	8,994,686	0.42
UniCredit SpA 144A, VRB	5.46%	30/06/35	USD	6,516	6,130,374	0.28
					47,394,572	2.20
JAPAN						
East Japan Railway Co	4.39%	05/09/43	EUR	1,334	1,604,087	0.08
Mizuho Financial Group Inc, VRB	5.78%	06/07/29	USD	7,750	7,980,145	0.37

BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
JAPAN (Fortsetzung)						
Mizuho Financial Group Inc, VRB	3.15%	16/07/30	USD	8,700	7,851,024	0.36
Nissan Motor Co Ltd 144A	4.35%	17/09/27	USD	6,553	6,277,312	0.29
Nissan Motor Co Ltd 144A	4.81%	17/09/30	USD	8,755	8,197,744	0.38
					31,910,312	1.48
MULTINATIONAL						
JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co. / JBS USA Finance, Inc.	6.50%	01/12/52	USD	6,120	6,153,096	0.28
NIEDERLANDE						
Enel Finance International NV 144A	7.75%	14/10/52	USD	5,812	7,181,840	0.33
Sartorius Finance BV	4.38%	14/09/29	EUR	7,200	8,250,129	0.38
Sartorius Finance BV	4.50%	14/09/32	EUR	4,200	4,842,191	0.23
Sartorius Finance BV	4.88%	14/09/35	EUR	6,600	7,703,654	0.36
					27,977,814	1.30
NORWEGEN						
Variable Energi ASA 144A	8.00%	15/11/32	USD	18,690	21,147,134	0.98
SPANIEN						
CaixaBank SA 144A, VRB	6.84%	13/09/34	USD	6,402	6,762,804	0.31
SCHWEDEN						
Swedbank AB 144A	5.34%	20/09/27	USD	10,883	10,915,840	0.51
SCHWEIZ						
Credit Suisse Group AG, FTB ^{±#}	9.75%	31/12/49†	USD	4,941	592,920	0.03
UBS Group AG 144A, VRB	9.02%	15/11/33	USD	9,204	11,329,363	0.52
					11,922,283	0.55
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Royalty Pharma Plc	3.30%	02/09/40	USD	8,166	6,161,041	0.29
Royalty Pharma Plc	3.55%	02/09/50	USD	9,970	7,114,288	0.33
					13,275,329	0.62
VEREINIGTE STAATEN						
Ally Financial Inc, VRB	6.99%	13/06/29	USD	7,340	7,595,998	0.35
Amgen Inc	5.75%	02/03/63	USD	6,880	7,247,002	0.34
AT&T Inc	3.65%	15/09/59	USD	14,741	10,599,509	0.49
Athene Global Funding 144A, FRB	6.11%	24/05/24	USD	12,400	12,392,339	0.57
Bank of America Corp, VRB	2.97%	04/02/33	USD	10,144	8,630,010	0.40
Bank of America Corp, VRB	4.57%	27/04/33	USD	9,630	9,195,317	0.43
Bank of America Corp, VRB	5.29%	25/04/34	USD	7,500	7,531,722	0.35
Bank of America Corp, VRB	5.87%	15/09/34	USD	9,360	9,814,414	0.45
Bank of America Corp, VRB	2.48%	21/09/36	USD	11,770	9,344,763	0.43
Bayer US Finance LLC 144A	6.13%	21/11/26	USD	6,320	6,423,269	0.30
Bayer US Finance LLC 144A	6.38%	21/11/30	USD	18,906	19,429,768	0.90
Booz Allen Hamilton Inc	5.95%	04/08/33	USD	6,500	6,879,043	0.32
Broadcom Inc 144A	4.93%	15/05/37	USD	24,098	23,332,675	1.08
Capital One Financial Corp, VRB	7.62%	30/10/31	USD	8,760	9,641,093	0.45
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	5.75%	01/04/48	USD	7,406	6,591,675	0.31
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	3.85%	01/04/61	USD	10,570	6,655,677	0.31
Citadel Finance LLC 144A	3.38%	09/03/26	USD	14,642	13,597,118	0.63

BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)						
Citigroup Inc, VRB	5.61%	29/09/26	USD	13,500	13,603,404	0.63
Citigroup Inc, VRB	3.06%	25/01/33	USD	7,340	6,275,480	0.29
Citigroup Inc, VRB	3.79%	17/03/33	USD	10,746	9,680,846	0.45
Citigroup Inc, VRB	4.91%	24/05/33	USD	7,460	7,313,582	0.34
Citigroup Inc, VRB	6.17%	25/05/34	USD	6,730	6,981,479	0.32
Citizens Bank NA/Providence RI, VRB	6.06%	24/10/25	USD	7,080	6,920,750	0.32
Columbia Pipelines Holding Co LLC 144A	6.04%	15/08/28	USD	6,420	6,635,541	0.31
Columbia Pipelines Operating Co LLC 144A	6.04%	15/11/33	USD	8,333	8,746,142	0.41
Constellation Energy Generation LLC	6.50%	01/10/53	USD	10,328	11,694,444	0.54
Continental Resources Inc/OK	4.90%	01/06/44	USD	13,705	11,111,685	0.51
Discover Financial Services, VRB	7.96%	02/11/34	USD	10,130	11,275,995	0.52
Fells Point Funding Trust 144A	3.05%	31/01/27	USD	8,040	7,597,803	0.35
Flex Intermediate Holdco LLC 144A	3.36%	30/06/31	USD	5,426	4,460,691	0.21
Flex Intermediate Holdco LLC 144A	4.32%	30/12/39	USD	6,770	5,002,014	0.23
Foundry JV Holdco LLC 144A	5.88%	25/01/34	USD	22,386	23,047,768	1.07
Fox Corp	6.50%	13/10/33	USD	15,140	16,403,827	0.76
GLP Capital LP / GLP Financing II Inc	5.30%	15/01/29	USD	8,860	8,826,207	0.41
GLP Capital LP / GLP Financing II Inc	3.25%	15/01/32	USD	8,008	6,798,733	0.31
Goldman Sachs Group Inc, VRB	2.38%	21/07/32	USD	14,824	12,196,650	0.57
Goldman Sachs Group Inc, VRB	2.65%	21/10/32	USD	15,586	13,005,037	0.60
Host Hotels & Resorts LP	3.38%	15/12/29	USD	8,718	7,855,493	0.36
Hyundai Capital America 144A	5.50%	30/03/26	USD	10,230	10,286,950	0.48
Intel Corp	5.70%	10/02/53	USD	9,747	10,565,671	0.49
KeyBank NA/Cleveland OH	5.85%	15/11/27	USD	10,640	10,647,261	0.49
KeyBank NA/Cleveland OH	4.90%	08/08/32	USD	8,547	7,565,599	0.35
Kimco Realty OP LLC	6.40%	01/03/34	USD	7,210	7,925,141	0.37
Kyndryl Holdings Inc	3.15%	15/10/31	USD	13,733	11,549,000	0.53
Kyndryl Holdings Inc	4.10%	15/10/41	USD	10,975	8,317,039	0.39
LKQ Corp	5.75%	15/06/28	USD	4,970	5,106,652	0.24
LPL Holdings Inc	6.75%	17/11/28	USD	6,369	6,787,626	0.31
M&T Bank Corp, VRB	7.41%	30/10/29	USD	4,980	5,370,769	0.25
M&T Bank Corp, VRB	5.05%	27/01/34	USD	8,190	7,776,514	0.36
Marvell Technology Inc	5.95%	15/09/33	USD	9,704	10,310,910	0.48
Meta Platforms Inc	4.45%	15/08/52	USD	10,663	9,823,317	0.45
Micron Technology Inc	5.88%	09/02/33	USD	6,978	7,287,860	0.34
Micron Technology Inc	5.88%	15/09/33	USD	8,414	8,759,183	0.41
Morgan Stanley, VRB	0.79%	30/05/25	USD	7,720	7,548,069	0.35
Morgan Stanley, VRB	6.30%	18/10/28	USD	5,280	5,538,368	0.26
Morgan Stanley, VRB	4.89%	20/07/33	USD	6,760	6,600,582	0.31
Morgan Stanley, VRB	5.25%	21/04/34	USD	7,080	7,085,319	0.33
Morgan Stanley, VRB	5.42%	21/07/34	USD	10,370	10,533,623	0.49
Morgan Stanley, VRB	2.48%	16/09/36	USD	13,539	10,755,262	0.50
Morgan Stanley, VRB	5.30%	20/04/37	USD	4,191	4,082,001	0.19
Morgan Stanley, VRB	5.95%	19/01/38	USD	3,230	3,272,301	0.15
Paramount Global	4.95%	15/01/31	USD	6,831	6,491,213	0.30
Paramount Global	5.85%	01/09/43	USD	9,073	8,194,145	0.38
Pilgrim's Pride Corp	6.25%	01/07/33	USD	7,450	7,675,640	0.36
Santander Holdings USA Inc, VRB	4.26%	09/06/25	USD	6,273	6,205,057	0.29
TD SYNnex Corp	1.25%	09/08/24	USD	13,670	13,333,554	0.62
TD SYNnex Corp	2.38%	09/08/28	USD	6,798	5,982,219	0.28
Utah Acquisition Sub Inc	5.25%	15/06/46	USD	6,347	5,299,508	0.25
Viatis Inc	4.00%	22/06/50	USD	12,625	8,914,410	0.41
VICI Properties LP / VICI Note Co Inc 144A	4.63%	15/06/25	USD	8,932	8,780,646	0.41
Volkswagen Group of America Finance LLC 144A	5.90%	12/09/33	USD	9,201	9,556,961	0.44
Warnermedia Holdings Inc	6.41%	15/03/26	USD	6,530	6,537,080	0.30
Warnermedia Holdings Inc	4.05%	15/03/29	USD	11,154	10,584,358	0.49
Warnermedia Holdings Inc	5.05%	15/03/42	USD	15,938	14,070,138	0.65

BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)						
Warnermedia Holdings Inc	5.14%	15/03/52	USD	11,220	9,665,040	0.45
Warnermedia Holdings Inc	5.39%	15/03/62	USD	4,530	3,899,742	0.18
Wells Fargo & Co, VRB	4.81%	25/07/28	USD	9,636	9,574,222	0.44
Wells Fargo & Co, VRB	4.90%	25/07/33	USD	9,261	9,033,099	0.42
Wells Fargo & Co, VRB	5.39%	24/04/34	USD	11,150	11,204,237	0.52
Wells Fargo & Co, VRB	5.56%	25/07/34	USD	11,950	12,183,249	0.56
Western Midstream Operating LP	6.15%	01/04/33	USD	7,720	8,030,879	0.37
					739,045,377	34.26
ANLEIHEN INSGESAMT					1,113,299,737	51.61
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt					1,113,299,737	51.61
Anlagen insgesamt <i>(Kosten USD 1,957,788,091)</i>					2,003,141,654	92.86
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					154,026,136	7.14
Nettovermögen insgesamt					2,157,167,790	100.00

Glossar:

FTB - Flat Trading Bond (pauschal gehandelte Anleihe)

FRB - Floating Rate Bond (Anleihe mit variablem Zins)

VRB - Variable Rate Bond (variabel verzinsliche Anleihe)

± notleidendes Wertpapier

† Unbefristete Laufzeit

Die Investition stellt eine zum beizulegenden Zeitwert bewertete Forderung dar

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.

Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
ANGOLA						
Angolanische internationale Staatsanleihe	9.50%	12/11/25	USD	200	198,250	0.04
Angolanische internationale Staatsanleihe	8.00%	26/11/29	USD	1,705	1,521,542	0.28
					<u>1,719,792</u>	<u>0.32</u>
ARGENTINIEN						
Argentinische internationale Staatsanleihe, FTB [±]	0.00%	15/12/35	EUR	2,000	115,436	0.02
Argentinische internationale Staatsanleihe, FTB [±]	0.00%	15/12/35	USD	5,000	200,000	0.04
Argentinische internationale Staatsanleihe, S/U	3.50%	09/07/41	USD	2,342	800,021	0.15
Argentinische internationale Staatsanleihe, S/U	3.63%	09/07/46	USD	1,096	379,565	0.07
					<u>1,495,022</u>	<u>0.28</u>
ÖSTERREICH						
Erste Group Bank AG, VRB	4.25%	31/12/49†	EUR	600	569,103	0.11
BRASILIEN						
Brazil Notas do Tesouro Nacional - Series F ^Ω	10.00%	01/01/25	BRL	17,329	3,738,069	0.69
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F ^Ω	10.00%	01/01/31	BRL	49,228	10,516,775	1.94
					<u>14,254,844</u>	<u>2.63</u>
BRITISCHE JUNGFERNSINSELN						
ANLLIAN Capital Ltd	0.00%	05/02/25	EUR	400	438,325	0.08
KAIMANINSELN						
EDO Sukuk Ltd	5.88%	21/09/33	USD	760	784,819	0.15
Lamar Funding Ltd	3.96%	07/05/25	USD	803	784,740	0.14
NIO Inc	0.50%	01/02/27	USD	883	814,591	0.15
XD Inc	1.25%	12/04/26	USD	1,214	1,173,222	0.22
Zhongsheng Group Holdings Ltd	0.00%	21/05/25	HKD	4,000	541,073	0.10
					<u>4,098,445</u>	<u>0.76</u>
CHILE						
Bonos de la Tesorería de la República en pesos 144A	5.30%	01/11/37	CLP	1,835,000	2,078,634	0.38
Chilenische internationale Staatsanleihe	4.95%	05/01/36	USD	1,730	1,712,700	0.32
Chilenische internationale Staatsanleihe	5.33%	05/01/54	USD	1,670	1,665,042	0.31
Corp. Nacional del Cobre de Chile	5.95%	08/01/34	USD	608	617,266	0.11
Corp. Nacional del Cobre de Chile	6.30%	08/09/53	USD	520	527,592	0.10
					<u>6,601,234</u>	<u>1.22</u>
KOLUMBIEN						
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	4.50%	15/03/29	USD	1,689	1,581,590	0.29
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	8.75%	14/11/53	USD	850	978,961	0.18
Kolumbianische TES	2.25%	18/04/29	COP	8,341,972	2,003,717	0.37
Kolumbianische TES	13.25%	09/02/33	COP	15,236,200	4,684,856	0.87
Ecopetrol SA	8.88%	13/01/33	USD	948	1,030,950	0.19

BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
KOLUMBIEN (Fortsetzung)						
Ecopetrol SA	5.88%	02/11/51	USD	1,300	988,813	0.18
					11,268,887	2.08
COSTA RICA						
Costa-ricanische internationale Staatsanleihe	7.30%	13/11/54	USD	950	1,033,610	0.19
DÄNEMARK						
Danske Bank, VRB	4.13%	10/01/31	EUR	4,502	5,158,864	0.95
DOMINIKANISCHE REPUBLIK						
Dominikanische internationale Staatsanleihe	5.50%	27/01/25	USD	879	876,121	0.16
Dominikanische internationale Staatsanleihe	6.88%	29/01/26	USD	1,956	1,995,531	0.37
Dominikanische internationale Staatsanleihe	5.95%	25/01/27	USD	189	190,054	0.03
Dominikanische internationale Staatsanleihe	6.00%	19/07/28	USD	160	160,640	0.03
Dominikanische internationale Staatsanleihe	13.63%	03/02/33	DOP	20,800	435,771	0.08
Dominikanische internationale Staatsanleihe	11.25%	15/09/35	DOP	57,100	1,064,041	0.20
					4,722,158	0.87
EL SALVADOR						
Internationale Staatsanleihe El Salvador	8.63%	28/02/29	USD	575	515,973	0.10
Internationale Staatsanleihe El Salvador	7.65%	15/06/35	USD	255	199,776	0.04
Internationale Staatsanleihe El Salvador	7.63%	01/02/41	USD	582	437,955	0.08
Internationale Staatsanleihe El Salvador	9.50%	15/07/52	USD	1,121	937,086	0.17
					2,090,790	0.39
FRANKREICH						
Banijay Group SAS	6.50%	01/03/26	EUR	1,557	1,721,008	0.32
Banque Federative du Credit Mutuel SA	3.75%	01/02/33	EUR	2,300	2,597,706	0.48
BNP Paribas SA 144A, VRB	7.75%	31/12/49†	USD	10,037	10,279,162	1.90
BPCE SA	4.00%	29/11/32	EUR	3,700	4,277,100	0.79
CAB SELAS	3.38%	01/02/28	EUR	538	530,702	0.10
Credit Agricole SA	4.38%	27/11/33	EUR	1,800	2,090,164	0.39
Credit Agricole SA, VRB	7.25%	31/12/49†	EUR	3,700	4,336,674	0.80
Credit Agricole SA, VRB	8.13%	31/12/49†	USD	2,380	2,431,125	0.45
Credit Mutuel Arkea SA	4.13%	01/02/34	EUR	4,900	5,698,812	1.05
Electricite de France SA, VRB	3.38%	31/12/49†	EUR	1,000	970,537	0.18
Societe Generale SA, VRB	4.88%	21/11/31	EUR	3,700	4,279,365	0.79
					39,212,355	7.25
DEUTSCHLAND						
Allianz SE, VRB	5.82%	25/07/53	EUR	4,200	5,086,031	0.94
Commerzbank AG, VRB	6.13%	31/12/49†	EUR	5,400	5,780,042	1.07
Commerzbank AG, VRB	6.50%	31/12/49†	EUR	3,400	3,574,338	0.66
Deutsche Bank AG, VRB	4.63%	31/12/49†	EUR	5,200	4,728,232	0.87
Deutsche Bank AG, VRB	10.00%	31/12/49†	EUR	4,000	4,829,186	0.89
Deutsche Lufthansa AG	2.00%	17/11/25	EUR	1,000	1,188,064	0.22

BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
DEUTSCHLAND (Fortsetzung)						
IHO Verwaltungs GmbH 144A, PIK	6.00%	15/05/27	USD	650	642,562	0.12
					25,828,455	4.77
HONGKONG						
Lenovo Group Ltd	2.50%	26/08/29	USD	760	1,031,981	0.19
ISLAND						
Iceland Rikisbref	4.50%	17/02/42	ISK	564,138	3,346,069	0.62
INDONESIEN						
Indonesische Schatzanweisung	8.38%	15/03/34	IDR	55,802,000	4,102,609	0.76
Indonesische Schatzanweisung	7.13%	15/06/38	IDR	33,881,000	2,307,217	0.42
					6,409,826	1.18
ISRAEL						
Leviathan Bond Ltd 144A	6.50%	30/06/27	USD	539	509,329	0.09
Leviathan Bond Ltd 144A	6.75%	30/06/30	USD	267	245,627	0.05
					754,956	0.14
ITALIEN						
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA, VRB	6.75%	02/03/26	EUR	2,231	2,523,424	0.47
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	5.50%	31/12/49†	EUR	400	410,729	0.08
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	5.88%	31/12/49†	EUR	2,284	2,282,872	0.42
Saipem SpA	2.88%	11/09/29	EUR	700	828,038	0.15
Telecom Italia SpA/Milano	6.88%	15/02/28	EUR	1,011	1,191,089	0.22
Telecom Italia SpA/Milano	7.88%	31/07/28	EUR	342	420,709	0.08
					7,656,861	1.42
JAPAN						
JFE Holdings Inc	0.00%	28/09/28	JPY	110,000	816,136	0.15
JERSEY						
Avis Budget Finance Plc	4.75%	30/01/26	EUR	1,063	1,174,991	0.22
Avis Budget Finance Plc	7.25%	31/07/30	EUR	1,064	1,262,575	0.23
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd	2.94%	30/09/40	USD	1,010	836,105	0.16
					3,273,671	0.61
KASACHSTAN						
KazMunayGas National Co JSC	4.75%	19/04/27	USD	800	782,000	0.14
LUXEMBURG						
Altice Financing SA 144A	5.75%	15/08/29	USD	1,678	1,490,014	0.27
EIG Pearl Holdings Sarl	3.55%	31/08/36	USD	1,000	873,750	0.16
Greensaif Pipelines Bidco Sarl	6.13%	23/02/38	USD	470	492,031	0.09
Greensaif Pipelines Bidco Sarl	6.51%	23/02/42	USD	798	842,513	0.16
Lagfin SCA	3.50%	08/06/28	EUR	700	760,678	0.14
					4,458,986	0.82
MAURITIUS						
Greenko Power II Ltd	4.30%	13/12/28	USD	900	820,125	0.15
HTA Group Ltd/Mauritius	2.88%	18/03/27	USD	1,000	871,560	0.16
					1,691,685	0.31

BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
MEXIKO						
America Movil SAB de CV	9.50%	27/01/31	MXN	19,400	1,112,340	0.21
Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, VRB	8.38%	31/12/49†	USD	1,103	1,090,382	0.20
Mexikanische Anleihen	7.75%	29/05/31	MXN	76,290	4,212,134	0.78
Mexikanische Anleihen	10.00%	20/11/36	MXN	32,310	2,059,382	0.38
Mexikanische Anleihen	7.75%	13/11/42	MXN	49,380	2,577,021	0.48
Mexico City Airport Trust	5.50%	31/07/47	USD	1,320	1,142,038	0.21
Mexikanische internationale Staatsanleihe	3.50%	12/02/34	USD	615	522,269	0.10
Mexikanische internationale Staatsanleihe	6.34%	04/05/53	USD	500	510,859	0.09
Mexikanische internationale Staatsanleihe	3.77%	24/05/61	USD	1,620	1,102,106	0.20
					14,328,531	2.65
MULTINATIONAL						
Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co.-Issuer, Inc. 144A, PIK	7.63%	15/10/25	USD	1,095	1,114,443	0.21
NIEDERLANDE						
ABN AMRO Bank NV, VRB	4.38%	31/12/49†	EUR	4,700	4,972,535	0.92
Cooperatieve Rabobank UA, VRB	4.88%	31/12/49†	EUR	1,400	1,399,605	0.26
Cooperatieve Rabobank UA, VRB	4.38%	31/12/49†	EUR	4,000	4,147,460	0.76
GTCR W-2 Merger Sub LLC / GTCR W Dutch Finance Sub BV	8.50%	15/01/31	GBP	771	1,065,678	0.20
ING Groep NV, VRB	4.50%	23/05/29	EUR	5,400	6,154,328	1.14
MV24 Capital BV	6.75%	01/06/34	USD	1,272	1,190,288	0.22
Prosus NV	1.99%	13/07/33	EUR	1,140	933,556	0.17
QIAGEN NV	1.00%	13/11/24	USD	800	822,752	0.15
STMicroelectronics NV	0.00%	04/08/27	USD	800	971,637	0.18
					21,657,839	4.00
NIGERIA						
Nigerianische internationale Staatsanleihe	7.88%	16/02/32	USD	1,021	920,655	0.17
NORDMAZEDONIEN						
Nordmazedonische internationale Staatsanleihe	6.96%	13/03/27	EUR	455	525,922	0.10
NORWEGEN						
DNB Bank ASA, VRB	4.50%	19/07/28	EUR	3,200	3,656,612	0.68
OMAN						
Omanische internationale Staatsanleihe	4.88%	01/02/25	USD	825	819,844	0.15
Omanische internationale Staatsanleihe	4.75%	15/06/26	USD	875	866,250	0.16
Omanische internationale Staatsanleihe	6.75%	17/01/48	USD	2,388	2,504,788	0.46
OQ SAOC	5.13%	06/05/28	USD	836	828,816	0.16
					5,019,698	0.93
PAKISTAN						
Pakistanische internationale Staatsanleihe	8.25%	15/04/24	USD	465	442,448	0.08

BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
PARAGUAY						
Paraguayische internationale Staatsanleihe	5.60%	13/03/48	USD	605	555,239	0.11
Paraguayische internationale Staatsanleihe	5.40%	30/03/50	USD	620	555,055	0.10
					<u>1,110,294</u>	<u>0.21</u>
PERU						
Peruanische Staatsanleihe 144A	7.30%	12/08/33	PEN	13,794	3,902,958	0.72
POLEN						
Bank Gospodarstwa Krajowego Polnische internationale Staatsanleihe	5.38%	22/05/33	USD	590	599,558	0.11
	5.50%	04/04/53	USD	932	975,235	0.18
					<u>1,574,793</u>	<u>0.29</u>
RUMÄNIEN						
Rumänische Staatsanleihe	4.25%	28/04/36	RON	28,525	5,261,253	0.97
Rumänische internationale Staatsanleihe	6.63%	17/02/28	USD	1,474	1,525,870	0.28
Rumänische internationale Staatsanleihe	7.13%	17/01/33	USD	718	776,628	0.14
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.00%	14/04/33	EUR	1,317	1,087,481	0.20
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.63%	02/12/40	EUR	2,347	1,749,794	0.32
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.75%	14/04/41	EUR	2,358	1,753,697	0.33
Rumänische internationale Staatsanleihe	4.00%	14/02/51	USD	560	406,305	0.08
Rumänische internationale Staatsanleihe	7.63%	17/01/53	USD	340	381,786	0.07
					<u>12,942,814</u>	<u>2.39</u>
SERBIEN						
Serbische internationale Anleihe	6.25%	26/05/28	USD	907	930,673	0.17
Serbische internationale Anleihe	6.50%	26/09/33	USD	1,070	1,099,200	0.20
Serbische internationale Anleihe	2.05%	23/09/36	EUR	557	430,140	0.08
					<u>2,460,013</u>	<u>0.45</u>
SÜDAFRIKA						
Südafrikanische Staatsanleihe	8.25%	31/03/32	ZAR	61,677	2,947,344	0.54
Südafrikanische Staatsanleihe	8.50%	31/01/37	ZAR	65,781	2,807,267	0.52
Südafrikanische internationale Staatsanleihe	5.75%	30/09/49	USD	1,472	1,179,425	0.22
					<u>6,934,036</u>	<u>1.28</u>
SÜDKOREA						
LG Chem Ltd	1.25%	18/07/28	USD	800	768,400	0.14
SK Hynix Inc	1.75%	11/04/30	USD	800	1,113,000	0.21
					<u>1,881,400</u>	<u>0.35</u>
SPANIEN						
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, VRB	8.38%	31/12/49†	EUR	4,000	4,796,248	0.89

BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
SPANIEN (Fortsetzung)						
Banco de Sabadell SA, VRB	5.50%	08/09/29	EUR	3,000	3,451,868	0.64
Banco Santander SA, VRB	9.63%	31/12/49†	USD	1,600	1,752,000	0.32
CaixaBank SA, VRB	8.25%	31/12/49†	EUR	1,400	1,641,720	0.30
CaixaBank SA, VRB	5.88%	31/12/49†	EUR	5,200	5,576,812	1.03
Cellnex Telecom SA	0.50%	05/07/28	EUR	1,000	1,179,603	0.22
					18,398,251	3.40
SCHWEIZ						
UBS Group AG, VRB	2.13%	13/10/26	EUR	4,905	5,267,005	0.97
TUNESIEN						
Tunesische Republik	5.63%	17/02/24	EUR	1,448	1,550,603	0.29
TÜRKEI						
Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS	8.51%	14/01/29	USD	470	499,610	0.09
Istanbul Metropolitan Municipality Mersin Uluslararası Liman Isletmeciligi AS	10.50%	06/12/28	USD	890	947,939	0.17
Türkische internationale Staatsanleihe	8.25%	15/11/28	USD	550	576,070	0.11
Türkische internationale Staatsanleihe	9.13%	13/07/30	USD	730	806,650	0.15
Türkische internationale Staatsanleihe	6.63%	17/02/45	USD	955	840,400	0.16
Türkische internationale Staatsanleihe	5.75%	11/05/47	USD	859	673,241	0.12
Türkiye Ihracat Kredi Bankasi AS	9.00%	28/01/27	USD	310	323,611	0.06
Ziraat Katilim Varlik Kiralama AS	9.38%	12/11/26	USD	620	654,197	0.12
					5,321,718	0.98
UKRAINE						
Ukrainische internationale Staatsanleihe, FTB †	7.38%	25/09/34	USD	3,775	901,281	0.17
Ukrainische internationale Staatsanleihe, FRB †	7.75%	01/08/41	USD	1,480	666,429	0.12
					1,567,710	0.29
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE						
Abu Dhabi internationale Staatsanleihe	2.70%	02/09/70	USD	1,623	1,032,187	0.19
First Abu Dhabi Bank PJSC, VRB	6.32%	04/04/34	USD	960	991,500	0.18
					2,023,687	0.37
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Barclays Plc, VRB	8.88%	31/12/49†	GBP	2,102	2,679,630	0.49
Barclays Plc, VRB	6.38%	31/12/49†	GBP	2,031	2,469,975	0.45
Barclays Plc, VRB	7.13%	31/12/49†	GBP	2,396	2,978,467	0.55
HSBC Holdings Plc, VRB	4.86%	23/05/33	EUR	4,460	5,234,983	0.97
Lloyds Banking Group Plc, VRB	8.50%	31/12/49†	GBP	1,152	1,497,177	0.28
Lloyds Banking Group Plc, VRB	8.50%	31/12/49†	GBP	609	785,715	0.15
Lloyds Banking Group Plc, VRB	7.88%	31/12/49†	GBP	1,504	1,880,192	0.35
Nationwide Building Society, VRB	5.75%	31/12/49†	GBP	1,600	1,886,155	0.35
NatWest Group Plc, VRB	4.77%	16/02/29	EUR	3,450	3,966,256	0.73
NatWest Group Plc, VRB	5.13%	31/12/49†	GBP	1,103	1,267,048	0.23
Vodafone Group Plc, VRB	3.00%	27/08/80	EUR	2,150	2,129,642	0.39
Vodafone Group Plc, VRB	8.00%	30/08/86	GBP	500	682,349	0.13
					27,457,589	5.07

BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTE STAATEN						
Belden Inc	3.38%	15/07/31	EUR	571	557,150	0.10
Ford Motor Credit Co LLC	7.35%	04/11/27	USD	1,822	1,922,635	0.36
Global Partners LP / GLP Finance Corp	7.00%	01/08/27	USD	1,111	1,087,247	0.20
Morgan Stanley, VRB	4.66%	02/03/29	EUR	2,994	3,436,789	0.63
Stillwater Mining Co	4.00%	16/11/26	USD	1,012	902,577	0.17
Stillwater Mining Co	4.50%	16/11/29	USD	1,372	1,089,594	0.20
Schatzanweisung der Vereinigten Staaten	4.63%	28/02/25	USD	17,392	17,383,708	3.21
					26,379,700	4.87
USBEKISTAN						
Usbekische internationale Staatsanleihe	4.75%	20/02/24	USD	835	833,043	0.15
Usbekische internationale Staatsanleihe	7.85%	12/10/28	USD	920	963,412	0.18
Usbekische internationale Staatsanleihe	3.90%	19/10/31	USD	935	786,861	0.15
Uzbekneftegaz JSC	4.75%	16/11/28	USD	1,167	973,898	0.18
					3,557,214	0.66
VIETNAM						
Vingroup JSC	10.00%	13/11/28	USD	400	400,466	0.07
					400,466	0.07
ANLEIHEN INSGESAMT						
					319,110,454	58.96
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt						
					319,110,454	58.96
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
ARGENTINIEN						
Provincia de Buenos Aires, S/U	6.38%	01/09/37	USD	1,500	580,635	0.11
AUSTRALIEN						
Mineral Resources Ltd 144A	8.00%	01/11/27	USD	925	949,630	0.18
Mineral Resources Ltd 144A	9.25%	01/10/28	USD	318	338,676	0.06
Mineral Resources Ltd 144A	8.50%	01/05/30	USD	917	957,111	0.18
					2,245,417	0.42
BERMUDA						
Tikehau US CLO III Ltd 144A, FRB	0.00%	20/01/36	USD	500	501,875	0.09
BRASILIEN						
Samarco Mineracao SA, PIK	9.50%	30/06/31	USD	2,737	2,296,270	0.42
KANADA						
Bombardier Inc 144A	6.00%	15/02/28	USD	1,011	986,211	0.18
NOVA Chemicals Corp 144A	4.25%	15/05/29	USD	1,781	1,501,670	0.28
					2,487,881	0.46
KAIMANINSELN						
Global Aircraft Leasing Co Ltd 144A, PIK	6.50%	15/09/24	USD	556	525,856	0.10
H World Group Ltd	3.00%	01/05/26	USD	652	702,804	0.13
Meituan	0.00%	27/04/28	USD	1,400	1,213,618	0.22
Oryx Funding Ltd	5.80%	03/02/31	USD	830	836,553	0.15

BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
KAIMANINSELN (Fortsetzung)						
Seagate HDD Cayman 144A	3.50%	01/06/28	USD	830	999,710	0.19
Wynn Macau Ltd 144A	4.50%	07/03/29	USD	782	799,790	0.15
ZTO Express Cayman Inc	1.50%	01/09/27	USD	851	812,723	0.15
					5,891,054	1.09
KOLUMBIEN						
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	7.50%	02/02/34	USD	847	895,438	0.17
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	8.00%	14/11/35	USD	1,150	1,260,148	0.23
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	5.00%	15/06/45	USD	1,050	815,719	0.15
Ecopetrol SA	8.63%	19/01/29	USD	770	823,539	0.15
					3,794,844	0.70
FRANKREICH						
Altice France SA/France 144A	8.13%	01/02/27	USD	866	797,948	0.15
Iliad Holding SASU 144A	6.50%	15/10/26	USD	1,429	1,427,514	0.26
Iliad Holding SASU 144A	7.00%	15/10/28	USD	980	976,387	0.18
					3,201,849	0.59
IRLAND						
AB Carval Euro CLO I-C DAC, FRB	7.12%	25/01/37	EUR	500	552,418	0.10
Anchorage Capital Europe CLO 6 DAC, FRB	0.00%	22/01/38	EUR	500	553,065	0.10
Ares European CLO XVI DAC, FRB	6.17%	15/07/35	EUR	2,365	2,623,910	0.48
Avoca CLO XIV DAC, FRB	6.59%	12/01/31	EUR	1,000	1,055,789	0.19
Bilbao CLO II DAC, FRB	7.10%	20/08/35	EUR	1,000	1,032,173	0.19
Blackrock European CLO III Designated Activity Co, FRB	5.97%	19/07/35	EUR	750	790,493	0.15
BNPP AM Euro CLO 2018 DAC, FRB	7.02%	15/04/31	EUR	1,200	1,255,619	0.23
Bridgepoint CLO 1 DAC, FRB	10.05%	15/01/34	EUR	1,250	1,314,609	0.24
Bridgepoint CLO 2 DAC, FRB	5.97%	15/04/35	EUR	1,000	1,051,225	0.19
Bridgepoint CLO IV DAC, FRB	6.19%	20/01/37	EUR	1,360	1,510,220	0.28
Capital Four CLO III DAC, FRB	7.07%	15/10/34	EUR	2,350	2,429,617	0.45
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO 2022-5 DAC	6.50%	25/10/35	EUR	1,250	1,377,414	0.25
CVC Cordatus Loan Fund XII DAC, FRB	7.20%	23/01/32	EUR	1,250	1,307,199	0.24
CVC Cordatus Loan Fund XV DAC, FRB	7.01%	26/08/32	EUR	1,000	1,036,049	0.19
Dryden 62 Euro CLO 2017 DAC, FRB	5.67%	15/07/31	EUR	1,655	1,751,032	0.32
Fidelity Grand Harbour CLO 2021-1 DAC, FRB	7.57%	15/10/34	EUR	1,000	1,057,543	0.20
Fidelity Grand Harbour CLO 2023-1 DAC, FRB	5.68%	15/08/36	EUR	1,000	1,109,923	0.21
Harvest CLO XXXI DAC, FRB	9.56%	15/10/36	EUR	500	547,272	0.10
Jubilee CLO 2021-XXV DAC, FRB	7.17%	15/10/35	EUR	1,355	1,419,608	0.26
LCPR Senior Secured Financing DAC 144A	6.75%	15/10/27	USD	2,027	1,976,325	0.37
Madison Park Euro Funding VIII DAC, FRB	7.67%	15/04/32	EUR	500	523,503	0.10
Marlay Park CLO DAC, FRB	6.37%	15/10/30	EUR	1,000	1,059,764	0.20
OCP Euro CLO 2022-6 DAC	6.80%	20/07/36	EUR	270	299,199	0.06
Penta CLO 2021-2 DAC, FRB	7.17%	04/11/34	EUR	600	632,918	0.12
Penta CLO 5 DAC, FRB	7.69%	20/04/35	EUR	1,100	1,181,832	0.22
Primrose Residential 2022-1 DAC, FRB	6.28%	24/10/61	EUR	359	375,380	0.07
Providus CLO VI DAC, FRB	7.20%	20/05/34	EUR	500	517,266	0.10

BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
IRLAND (Fortsetzung)						
Sculptor European CLO IX DAC, FRB	7.32%	10/04/34	EUR	900	954,298	0.18
Sound Point Euro CLO IV Funding DAC, FRB	8.47%	15/01/35	EUR	750	828,622	0.15
Toro European CLO 7 DAC, FRB	7.60%	15/02/34	EUR	1,000	1,066,838	0.20
Trinitas Euro CLO IV DAC, FRB	5.75%	15/05/38	EUR	1,000	1,106,204	0.20
Trinitas Euro CLO IV DAC, FRB	10.00%	15/05/38	EUR	1,310	1,455,185	0.27
					35,752,512	6.61
ITALIEN						
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	7.75%	31/12/49†	EUR	5,240	5,949,740	1.10
JERSEY						
Adient Global Holdings Ltd 144A	4.88%	15/08/26	USD	1,001	983,483	0.18
Adient Global Holdings Ltd 144A	8.25%	15/04/31	USD	1,340	1,423,187	0.26
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd	2.16%	31/03/34	USD	1,187	1,033,328	0.19
Halsey Point CLO 7 LTD 144A, FRB	7.51%	20/07/36	USD	3,295	3,323,498	0.61
Orion CLO 2023-2 Ltd 144A, FRB	10.61%	25/01/37	USD	1,500	1,505,498	0.28
Prudential Plc 144A, FRB	11.00%	20/01/37	USD	1,500	1,505,883	0.28
Warwick Capital CLO 2 Ltd 144A, FRB	11.33%	15/01/37	USD	1,000	1,000,095	0.19
WISE CLO 2023-1 Ltd 144A, FRB	7.52%	20/10/36	USD	850	850,796	0.16
					11,625,768	2.15
LUXEMBURG						
Guara Norte Sarl	5.20%	15/06/34	USD	850	779,331	0.14
MEXIKO						
BBVA Bancomer SA/Texas, VRB	8.45%	29/06/38	USD	680	723,282	0.13
Mexikanische internationale Staatsanleihe	2.13%	25/10/51	EUR	626	419,578	0.08
					1,142,860	0.21
PAKISTAN						
Pakistanische internationale Staatsanleihe	6.88%	05/12/27	USD	400	274,625	0.05
PARAGUAY						
Paraguayische internationale Staatsanleihe	5.85%	21/08/33	USD	790	807,182	0.15
Telefonica Celular del Paraguay SA	5.88%	15/04/27	USD	1,110	1,087,961	0.20
					1,895,143	0.35
SINGAPUR						
Medco Maple Tree Pte Ltd	8.96%	27/04/29	USD	810	828,225	0.15
SCHWEIZ						
Credit Suisse Group AG, FTB ±#	7.50%	31/12/49†	USD	1,340	160,800	0.03
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
London Wall Mortgage Capital Plc	6.77%	15/05/51	GBP	450	565,462	0.10
NatWest Group Plc, VRB	8.00%	31/12/49†	USD	4,450	4,472,673	0.83
					5,038,135	0.93

BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTE STAATEN						
ADT Security Corp 144A	4.13%	01/08/29	USD	1,637	1,508,250	0.28
Airbnb Inc	0.00%	15/03/26	USD	878	791,398	0.15
Akamai Technologies Inc 144A	1.13%	15/02/29	USD	1,159	1,259,740	0.23
American Airlines Group Inc	6.50%	01/07/25	USD	679	756,508	0.14
AmeriTex HoldCo Intermediate LLC 144A	10.25%	15/10/28	USD	1,162	1,192,502	0.22
BCPE Ulysses Intermediate Inc 144A, PIK	7.75%	01/04/27	USD	317	296,027	0.05
Blackrock MT Hood CLO X LLC 144A, FRB	7.92%	20/04/35	USD	2,310	2,315,771	0.43
Camelot Return Merger Sub Inc 144A	8.75%	01/08/28	USD	1,904	1,935,081	0.36
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 144A	7.38%	01/03/31	USD	2,407	2,471,963	0.46
Citigroup Inc, VRB	0.98%	01/05/25	USD	2,000	1,966,537	0.36
Civitas Resources Inc 144A	8.38%	01/07/28	USD	913	954,263	0.18
Civitas Resources Inc 144A	8.75%	01/07/31	USD	871	928,309	0.17
COLT 2023-4 Mortgage Loan Trust 144A, S/U	7.16%	25/10/68	USD	695	715,052	0.13
Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03 144A, FRB	6.99%	25/12/41	USD	261	258,274	0.05
Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R02 144A, FRB	8.69%	25/01/43	USD	250	262,518	0.05
Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R04 144A, FRB	8.89%	25/05/43	USD	517	550,603	0.10
Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R07 144A, FRB	7.29%	25/09/43	USD	1,984	2,003,113	0.37
CQP Holdco LP / BIP-V Chinook Holdco LLC 144A	5.50%	15/06/31	USD	2,081	1,974,889	0.36
CQP Holdco LP / BIP-V Chinook Holdco LLC 144A	7.50%	15/12/33	USD	1,604	1,664,209	0.31
Datadog Inc	0.13%	15/06/25	USD	580	815,845	0.15
Dealer Tire LLC / DT Issuer LLC 144A	8.00%	01/02/28	USD	1,934	1,916,913	0.35
Dexcom Inc 144A	0.38%	15/05/28	USD	793	814,665	0.15
DISH DBS Corp 144A	5.25%	01/12/26	USD	1,713	1,470,825	0.27
DISH DBS Corp 144A	5.75%	01/12/28	USD	611	488,479	0.09
Domtar Corp 144A	6.75%	01/10/28	USD	1,777	1,608,433	0.30
EQM Midstream Partners LP 144A	7.50%	01/06/30	USD	1,839	1,979,056	0.37
EQT Corp	1.75%	01/05/26	USD	254	678,081	0.13
Etsy Inc	0.13%	01/10/26	USD	852	983,029	0.18
Exact Sciences Corp	0.38%	15/03/27	USD	1,074	1,046,354	0.19
Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp 144A	5.38%	01/04/26	USD	2,028	1,986,615	0.37
Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp 144A	5.88%	01/04/29	USD	2,104	1,989,769	0.37
Ford Motor Co	0.00%	15/03/26	USD	1,001	1,000,531	0.18
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7 144A, FRB	7.14%	25/11/41	USD	224	222,072	0.04
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA1 144A, FRB	7.19%	25/01/42	USD	500	501,112	0.09
Gray Television Inc 144A	7.00%	15/05/27	USD	1,518	1,444,309	0.27
GTCR W-2 Merger Sub LLC 144A	7.50%	15/01/31	USD	1,015	1,073,233	0.20
Iron Mountain Inc 144A	7.00%	15/02/29	USD	933	959,593	0.18
ITT Holdings LLC 144A	6.50%	01/08/29	USD	2,762	2,446,207	0.45
LBM Acquisition LLC 144A	6.25%	15/01/29	USD	1,096	979,797	0.18
LifePoint Health Inc 144A	9.88%	15/08/30	USD	2,024	2,047,966	0.38
LifePoint Health Inc 144A	11.00%	15/10/30	USD	907	956,343	0.18
Macy's Retail Holdings LLC 144A	5.88%	15/03/30	USD	762	724,993	0.13
Macy's Retail Holdings LLC 144A	6.13%	15/03/32	USD	851	806,301	0.15
Marriott Vacations Worldwide Corp	0.00%	15/01/26	USD	908	804,760	0.15
MP Materials Corp 144A	0.25%	01/04/26	USD	1,424	1,261,489	0.23
Neptune Bidco US Inc 144A	9.29%	15/04/29	USD	1,987	1,854,502	0.34
Nissan Motor Acceptance Co LLC 144A	1.85%	16/09/26	USD	2,198	1,977,588	0.37

BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)						
Northern Oil & Gas Inc	3.63%	15/04/29	USD	692	819,383	0.15
OBX 2023-NQM9 Trust 144A, S/U	7.16%	25/10/63	USD	423	433,723	0.08
ON Semiconductor Corp 144A	0.50%	01/03/29	USD	776	819,472	0.15
Paramount Global, VRB	6.38%	30/03/62	USD	2,291	2,064,649	0.38
Permian Resources Operating LLC 144A	9.88%	15/07/31	USD	1,641	1,825,416	0.34
Rand Parent LLC 144A	8.50%	15/02/30	USD	1,901	1,820,076	0.34
Rivian Automotive Inc 144A	4.63%	15/03/29	USD	920	1,289,546	0.24
Sapphire Aviation Finance II Ltd 144A	4.34%	15/03/40	USD	1,308	975,082	0.18
SierraCol Energy Andina LLC	6.00%	15/06/28	USD	491	413,638	0.08
Smyrna Ready Mix Concrete LLC 144A	6.00%	01/11/28	USD	1,668	1,644,722	0.30
Smyrna Ready Mix Concrete LLC 144A	8.88%	15/11/31	USD	526	553,497	0.10
Spirit AeroSystems Inc 144A	9.75%	15/11/30	USD	963	1,036,404	0.19
Sprint LLC	7.13%	15/06/24	USD	1,914	1,923,593	0.36
Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp 144A	6.00%	31/12/30	USD	2,091	1,946,779	0.36
Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp 144A	6.00%	01/09/31	USD	529	490,047	0.09
TEGNA Inc	5.00%	15/09/29	USD	1,146	1,051,489	0.19
Tenet Healthcare Corp	6.13%	01/10/28	USD	1,703	1,699,679	0.31
TransDigm Inc 144A	6.25%	15/03/26	USD	1,040	1,039,259	0.19
Uber Technologies Inc	0.00%	15/12/25	USD	778	799,558	0.15
Univision Communications Inc 144A	6.63%	01/06/27	USD	981	979,036	0.18
US Foods Inc 144A	6.88%	15/09/28	USD	552	568,897	0.11
US Foods Inc 144A	7.25%	15/01/32	USD	825	861,269	0.16
Verus Securitization Trust 2023-6 144A, S/U	6.67%	25/09/68	USD	589	599,350	0.11
Verus Securitization Trust 2023- INV2 144A, S/U	6.44%	25/08/68	USD	291	294,931	0.05
VICI Properties LP / VICI Note Co Inc 144A	3.50%	15/02/25	USD	1,464	1,427,481	0.26
Voyager Aviation Holdings LLC 144A [±]	8.50%	09/05/26	USD	965	791,460	0.15
Wells Fargo & Co, VRB	6.30%	23/10/29	USD	4,056	4,277,219	0.79
Western Digital Corp 144A	3.00%	15/11/28	USD	673	824,856	0.15
ZF North America Capital Inc 144A	4.75%	29/04/25	USD	811	802,318	0.15
Zillow Group Inc	0.75%	01/09/24	USD	676	915,257	0.17
Zscaler Inc	0.13%	01/07/25	USD	534	811,878	0.15
					94,443,831	17.45
ANLEIHEN INSGESAMT					178,890,795	33.05
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt					178,890,795	33.05
Sonstige Wertpapiere						
ANLEIHEN						
AUSTRALIEN						
Quintis Australia Pty Ltd, PIK ^α	7.50%	01/10/26	USD	61	17,618	0.00
Quintis Australia Pty Ltd, PIK ^α	0.00%	01/10/28	USD	569	0	0.00
Quintis Australia Pty Ltd 144A, PIK ^α	7.50%	01/10/26	USD	815	234,818	0.04
					252,436	0.04

BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Sonstige Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTE STAATEN						
Freddie Mac Pool	6.00%	01/09/53	USD	1,544	1,568,773	0.29
ANLEIHEN INSGESAMT					1,821,209	0.33
STAMMAKTIEN						
AUSTRALIEN						
Quintis ^α			USD	278	0	0.00
VEREINIGTE STAATEN						
W.R. Grace & Co			USD	22	2	0.00
STAMMAKTIEN INSGESAMT					2	0.00
OPTIONSSCHEINE						
MEXIKO						
Urbi Warrant			MXN	7	0	0.00
OPTIONSSCHEINE INSGESAMT					0	0.00
Sonstige Wertpapiere insgesamt					1,821,211	0.33
Anlagen insgesamt (Kosten USD 485,957,603)					499,822,460	92.34
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					41,433,476	7.66
Nettovermögen insgesamt					541,255,936	100.00

Glossar:

FTB - Flat Trading Bond (pauschal gehandelte Anleihe)

FRB - Floating Rate Bond (Anleihe mit variablem Zins)

PIK - Payment-in-Kind (Sachleistung)

S/U - Step Up Bond

VRB - Variable Rate Bond (variabel verzinsliche Anleihe)

Ω Wertpapier mit „Dirty Price“ bewertet

± notleidendes Wertpapier

† Unbefristete Laufzeit

α Wertpapier zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Die Investition stellt eine zum beizulegenden Zeitwert bewertete Forderung dar

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.

Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay Financial Capital Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
ÖSTERREICH						
Erste Group Bank AG, VRB	8.50%	31/12/49†	EUR	30,600	35,749,833	2.13
BELGIEN						
KBC Group NV, VRB	8.00%	31/12/49†	EUR	21,200	24,926,234	1.49
FRANKREICH						
BNP Paribas SA, VRB	7.38%	31/12/49†	EUR	9,800	11,554,874	0.69
BNP Paribas SA 144A, VRB	7.75%	31/12/49†	USD	58,894	60,314,933	3.60
					71,869,807	4.29
DEUTSCHLAND						
Commerzbank AG, VRB	6.13%	31/12/49†	EUR	45,800	49,023,318	2.93
Commerzbank AG, VRB	6.50%	31/12/49†	EUR	29,400	30,907,507	1.84
Deutsche Bank AG, VRB	6.75%	31/12/49†	EUR	36,200	37,292,319	2.23
Deutsche Bank AG, VRB	10.00%	31/12/49†	EUR	98,800	119,280,892	7.12
					236,504,036	14.12
IRLAND						
Bank of Ireland Group Plc, VRB	6.00%	31/12/49†	EUR	47,900	52,280,210	3.12
ITALIEN						
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	10.50%	23/07/29	EUR	35,520	43,164,588	2.58
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	9.13%	31/12/49†	EUR	49,700	60,514,018	3.61
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	5.50%	31/12/49†	EUR	9,608	9,865,707	0.59
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	5.88%	31/12/49†	EUR	5,607	5,604,232	0.34
					119,148,545	7.12
NIEDERLANDE						
ABN AMRO Bank NV, VRB	4.38%	31/12/49†	EUR	24,200	25,603,264	1.53
Cooperatieve Rabobank UA, VRB	4.38%	31/12/49†	EUR	54,600	56,612,834	3.38
Cooperatieve Rabobank UA, VRB	4.63%	31/12/49†	EUR	16,200	17,273,709	1.03
ING Groep NV, VRB	5.75%	31/12/49†	USD	4,653	4,354,077	0.26
ING Groep NV, VRB	6.50%	31/12/49†	USD	12,246	11,982,356	0.72
					115,826,240	6.92
SPANIEN						
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, VRB	6.00%	31/12/49†	EUR	39,200	43,124,865	2.57
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, VRB	8.38%	31/12/49†	EUR	32,400	38,849,611	2.32
Banco de Sabadell SA, VRB	9.38%	31/12/49†	EUR	18,800	22,249,868	1.33
Banco de Sabadell SA, VRB	5.75%	31/12/49†	EUR	55,800	58,600,706	3.50
Banco Santander SA, VRB	9.63%	31/12/49†	USD	32,800	35,944,113	2.15
Banco Santander SA, VRB	4.38%	31/12/49†	EUR	10,600	10,812,248	0.65
CaixaBank SA, VRB	5.88%	31/12/49†	EUR	71,800	77,002,908	4.60
CaixaBank SA, VRB	6.75%	31/12/49†	EUR	3,400	3,758,133	0.22
					290,342,452	17.34
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Barclays Plc, VRB	8.88%	31/12/49†	GBP	57,750	73,563,450	4.39
Barclays Plc, VRB	9.25%	31/12/49†	GBP	64,894	82,628,721	4.94
Barclays Plc, VRB	7.13%	31/12/49†	GBP	3,006	3,739,008	0.22
Lloyds Banking Group Plc, VRB	8.50%	31/12/49†	GBP	44,080	57,276,667	3.42
Lloyds Banking Group Plc, VRB	7.88%	31/12/49†	GBP	18,240	22,799,086	1.36
Nationwide Building Society, VRB	5.75%	31/12/49†	GBP	6,386	7,527,346	0.45

BlueBay Funds – BlueBay Financial Capital Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)						
NatWest Group Plc, VRB	5.13%	31/12/49†	GBP	20,584	23,634,914	1.41
NatWest Group Plc, VRB	6.00%	31/12/49†	USD	42,050	40,861,930	2.44
					312,031,122	18.63
ANLEIHEN INSGESAMT					1,258,678,479	75.16
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt					1,258,678,479	75.16
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
FRANKREICH						
Societe Generale SA, VRB	9.38%	31/12/49†	USD	37,844	39,576,552	2.36
ITALIEN						
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA, VRB	8.00%	22/01/30	EUR	10,524	11,706,278	0.70
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA, VRB	8.50%	10/09/30	EUR	20,134	22,378,710	1.34
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	7.75%	31/12/49†	EUR	71,909	81,648,836	4.87
					115,733,824	6.91
SCHWEIZ						
Credit Suisse Group AG, FTB †#	9.75%	31/12/49†	USD	84,106	10,092,720	0.60
Credit Suisse Group AG 144A, FTB †#	9.75%	31/12/49†	USD	9,350	1,122,000	0.07
Credit Suisse Group AG 144A, FTB †#	6.38%	31/12/49†	USD	9,911	1,189,320	0.07
UBS Group AG, VRB	9.25%	31/12/49†	USD	37,350	41,474,151	2.48
					53,878,191	3.22
ANLEIHEN INSGESAMT					209,188,567	12.49
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt					209,188,567	12.49
Sonstige Wertpapiere						
ANLEIHEN						
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Nationwide Building Society	10.25%	31/12/49†	GBP	19,618	32,585,159	1.95
ANLEIHEN INSGESAMT					32,585,159	1.95
Sonstige Wertpapiere insgesamt					32,585,159	1.95

BlueBay Funds – BlueBay Financial Capital Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Anlagen insgesamt <i>(Kosten USD 1,572,038,195)</i>	1,500,452,205	89.60
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten	174,122,943	10.40
Nettovermögen insgesamt	<u>1,674,575,148</u>	<u>100.00</u>

Glossar:

FTB - Flat Trading Bond (pauschal gehandelte Anleihe)

VRB - Variable Rate Bond (variabel verzinsliche Anleihe)

± notleidendes Wertpapier

† Unbefristete Laufzeit

Die Investition stellt eine zum beizulegenden Zeitwert bewertete Forderung dar

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.

Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
ÖSTERREICH						
Österreichische Staatsanleihe 144A	2.90%	23/05/29	EUR	2,332	2,655,646	0.24
Österreichische Staatsanleihe 144A	3.15%	20/10/53	EUR	2,468	2,854,527	0.25
					5,510,173	0.49
BELGIEN						
Belgische Staatsanleihe 144A	3.00%	22/06/33	EUR	5,893	6,722,099	0.60
KANADA						
Fairfax Financial Holdings Ltd	2.75%	29/03/28	EUR	1,660	1,750,885	0.16
CHILE						
Bonos de la Tesorería de la República en pesos 144A ^Ω	4.70%	01/09/30	CLP	330,000	371,070	0.03
Corp. Nacional del Cobre de Chile	5.95%	08/01/34	USD	2,280	2,314,781	0.21
Corp. Nacional del Cobre de Chile	6.30%	08/09/53	USD	830	841,615	0.08
					3,527,466	0.32
DÄNEMARK						
TDC Net A/S	6.50%	01/06/31	EUR	1,780	2,084,118	0.19
ESTLAND						
Estnische internationale Staatsanleihe	0.13%	10/06/30	EUR	1,898	1,746,513	0.16
Estnische internationale Staatsanleihe	4.00%	12/10/32	EUR	7,247	8,629,626	0.77
					10,376,139	0.93
FRANKREICH						
Banque Federative du Credit Mutuel SA	4.75%	10/11/31	EUR	4,900	5,750,486	0.51
BNP Paribas SA	1.38%	28/05/29	EUR	3,400	3,383,383	0.30
BNP Paribas SA, VRB	4.75%	13/11/32	EUR	7,900	9,268,242	0.83
BNP Paribas SA 144A, VRB	7.75%	31/12/49†	USD	4,241	4,343,322	0.39
BPCE SA	4.50%	13/01/33	EUR	3,800	4,419,507	0.40
BPCE SA, VRB	2.13%	13/10/46	EUR	6,200	5,582,010	0.50
Credit Agricole SA	4.00%	18/01/33	EUR	1,600	1,860,965	0.17
Credit Agricole SA	4.38%	27/11/33	EUR	3,200	3,715,848	0.33
Electricite de France SA	4.63%	25/01/43	EUR	6,200	7,231,686	0.65
Electricite de France SA, VRB	7.50%	31/12/49†	EUR	3,000	3,628,426	0.32
Electricite de France SA, VRB	9.13%	31/12/49†	USD	880	982,540	0.09
Electricite de France SA, VRB	3.00%	31/12/49†	EUR	600	605,826	0.05
Electricite de France SA, VRB	3.38%	31/12/49†	EUR	2,600	2,523,395	0.23
Electricite de France SA, VRB	4.00%	31/12/49†	EUR	2,100	2,305,086	0.21
Electricite de France SA, VRB	5.00%	31/12/49†	EUR	1,600	1,767,429	0.16
Electricite de France SA, VRB	6.00%	31/12/49†	GBP	800	995,340	0.09
Engie SA	4.25%	06/09/34	EUR	2,300	2,698,054	0.24
Engie SA	4.50%	06/09/42	EUR	1,500	1,788,769	0.16
Französische Staatsanleihe OAT	0.75%	25/11/28	EUR	5,009	5,160,370	0.46
Französische Staatsanleihe OAT	1.25%	25/05/34	EUR	3,068	2,978,317	0.27
Suez SACA	5.00%	03/11/32	EUR	3,800	4,649,044	0.42
Suez SACA	2.88%	24/05/34	EUR	2,600	2,683,478	0.24
TDF Infrastructure SASU	5.63%	21/07/28	EUR	4,800	5,575,989	0.50

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
FRANKREICH (Fortsetzung)						
Ubisoft Entertainment SA	0.88%	24/11/27	EUR	4,300	4,042,094	0.36
					87,939,606	7.88
DEUTSCHLAND						
Allianz SE, VRB	5.82%	25/07/53	EUR	4,400	5,328,223	0.48
Bayer AG	4.25%	26/08/29	EUR	2,273	2,605,042	0.23
Bayer AG	4.63%	26/05/33	EUR	248	286,500	0.03
Bayer AG, VRB	6.63%	25/09/83	EUR	1,700	1,916,069	0.17
Bayer AG, VRB	7.00%	25/09/83	EUR	1,400	1,600,389	0.14
Bundesobligation	0.00%	09/10/26	EUR	4,175	4,352,764	0.39
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	1.70%	15/08/32	EUR	611	660,595	0.06
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.00%	15/05/36	EUR	7,760	6,575,758	0.59
Commerzbank AG, VRB	6.13%	31/12/49†	EUR	4,600	4,923,739	0.44
Commerzbank AG, VRB	6.50%	31/12/49†	EUR	2,200	2,312,807	0.21
Deutsche Bank AG, VRB	1.75%	19/11/30	EUR	5,100	4,905,354	0.44
Deutsche Bank AG, VRB	5.63%	19/05/31	EUR	800	896,427	0.08
Volkswagen Leasing GmbH	4.75%	25/09/31	EUR	953	1,123,824	0.10
					37,487,491	3.36
GRIECHENLAND						
Griechische Staatsanleihe 144A	4.25%	15/06/33	EUR	3,769	4,566,691	0.41
Griechische Staatsanleihe 144A	4.38%	18/07/38	EUR	12,823	15,574,234	1.39
					20,140,925	1.80
ISLAND						
Iceland Rikisbref	4.50%	17/02/42	ISK	1,040,462	6,061,074	0.54
INDONESIEN						
Indonesische Schatzanweisung	7.00%	15/09/30	IDR	48,809,000	3,248,211	0.29
IRLAND						
Irische Staatsanleihe	1.35%	18/03/31	EUR	1,091	1,133,968	0.10
Johnson Controls International Plc	4.25%	23/05/35	EUR	1,916	2,246,900	0.20
					3,380,868	0.30
ISRAEL						
Israelische internationale Staatsanleihe	6.50%	06/11/31	USD	7,839	8,454,483	0.76
Israelische internationale Staatsanleihe	0.63%	18/01/32	EUR	14,261	12,189,879	1.09
					20,644,362	1.85
ITALIEN						
ASTM SpA	1.50%	25/01/30	EUR	3,320	3,197,166	0.29
ASTM SpA	2.38%	25/11/33	EUR	3,543	3,294,436	0.29
Autostrade per l'Italia SpA	2.00%	15/01/30	EUR	6,461	6,344,024	0.57
Autostrade per l'Italia SpA	2.25%	25/01/32	EUR	2,640	2,513,353	0.23
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	9.13%	31/12/49†	EUR	2,480	3,019,613	0.27
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	5.88%	31/12/49†	EUR	1,800	1,799,111	0.16
					20,167,703	1.81

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
JAPAN						
Japanische zehnjährige Staatsanleihe	0.10%	20/03/27	JPY	1,342,350	9,531,277	0.85
Japanische dreißigjährige Staatsanleihe	1.50%	20/03/45	JPY	1,343,600	9,618,945	0.86
Japanische dreißigjährige Staatsanleihe	0.30%	20/06/46	JPY	725,600	3,985,201	0.36
Japanische dreißigjährige Staatsanleihe	0.80%	20/12/47	JPY	1,117,900	6,765,097	0.61
					29,900,520	2.68
LETTLAND						
Lettische internationale Staatsanleihe	3.88%	12/07/33	EUR	6,490	7,517,046	0.67
LUXEMBURG						
Chile Electricity Lux MPC Sarl	6.01%	20/01/33	USD	2,790	2,872,876	0.26
Eurofins Scientific SE	4.75%	06/09/30	EUR	3,224	3,756,323	0.34
Medtronic Global Holdings SCA	1.50%	02/07/39	EUR	460	388,739	0.03
Medtronic Global Holdings SCA	1.63%	15/10/50	EUR	484	365,659	0.03
Simon International Finance SCA	1.13%	19/03/33	EUR	5,205	4,668,677	0.42
					12,052,274	1.08
MEXIKO						
Mexikanische Anleihen	5.50%	04/03/27	MXN	971,600	51,344,549	4.60
Mexikanische Anleihen	8.50%	01/03/29	MXN	310,120	17,892,588	1.60
Mexikanische Anleihen	7.75%	29/05/31	MXN	345,140	19,078,772	1.71
Mexikanische internationale Staatsanleihe	4.00%	15/03/15^	EUR	19,350	16,582,209	1.49
					104,898,118	9.40
NIEDERLANDE						
Abertis Infraestructuras Finance BV, VRB	3.25%	31/12/49†	EUR	6,900	7,331,135	0.66
Cooperatieve Rabobank UA, VRB	4.88%	31/12/49†	EUR	1,600	1,599,549	0.14
EnBW International Finance BV	4.30%	23/05/34	EUR	5,466	6,392,261	0.57
JAB Holdings BV	5.00%	12/06/33	EUR	2,100	2,504,556	0.22
Telefonica Europe BV, VRB	2.38%	31/12/49†	EUR	800	769,449	0.07
Telefonica Europe BV, VRB	6.14%	31/12/49†	EUR	200	227,939	0.02
Thermo Fisher Scientific Finance I BV	1.63%	18/10/41	EUR	601	502,293	0.05
Thermo Fisher Scientific Finance I BV	2.00%	18/10/51	EUR	1,140	905,705	0.08
Volkswagen International Finance NV, VRB	3.88%	31/12/49†	EUR	400	422,209	0.04
Volkswagen International Finance NV, VRB	4.63%	31/12/49†	EUR	200	214,566	0.02
Wintershall Dea Finance 2 BV, VRB	3.00%	31/12/49†	EUR	5,200	5,030,375	0.45
Wintershall Dea Finance BV	1.82%	25/09/31	EUR	1,100	1,048,641	0.09
					26,948,678	2.41
NORWEGEN						
Variable Energi ASA, VRB	7.86%	15/11/83	EUR	2,310	2,721,690	0.24
PERU						
Peruanische Staatsanleihe	6.15%	12/08/32	PEN	1,463	386,369	0.03

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
RUMÄNIEN						
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.75%	26/02/26	EUR	3,041	3,304,289	0.30
Rumänische internationale Staatsanleihe	6.63%	17/02/28	USD	2,390	2,477,332	0.22
Rumänische internationale Staatsanleihe	5.50%	18/09/28	EUR	9,570	10,886,681	0.98
Rumänische internationale Staatsanleihe	3.62%	26/05/30	EUR	804	818,132	0.07
Rumänische internationale Staatsanleihe	1.75%	13/07/30	EUR	2,005	1,796,250	0.16
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.12%	16/07/31	EUR	4,316	3,810,665	0.34
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.00%	28/01/32	EUR	2,246	1,925,480	0.17
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.00%	14/04/33	EUR	5,007	4,152,079	0.37
Rumänische internationale Staatsanleihe	3.88%	29/10/35	EUR	1,549	1,461,886	0.13
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.63%	02/12/40	EUR	8,108	6,046,510	0.54
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.75%	14/04/41	EUR	6,961	5,180,472	0.46
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.88%	13/04/42	EUR	12,567	9,428,246	0.85
Rumänische internationale Staatsanleihe	4.63%	03/04/49	EUR	3,570	3,321,561	0.30
Rumänische internationale Staatsanleihe	3.38%	28/01/50	EUR	5,886	4,446,993	0.40
					59,056,576	5.29
SLOWENIEN						
Slowenische Staatsanleihe	0.00%	12/02/31	EUR	1,500	1,361,549	0.12
SÜDAFRIKA						
Südafrikanische Staatsanleihe	8.88%	28/02/35	ZAR	238,663	11,017,470	0.99
Südafrikanische Staatsanleihe	8.50%	31/01/37	ZAR	308,389	13,159,211	1.18
					24,176,681	2.17
SPANIEN						
Banco Santander SA	4.88%	18/10/31	EUR	3,400	4,004,768	0.36
CaixaBank SA	4.38%	29/11/33	EUR	4,100	4,765,411	0.43
CaixaBank SA, VRB	5.00%	19/07/29	EUR	700	809,429	0.07
CaixaBank SA, VRB	5.13%	19/07/34	EUR	3,100	3,662,926	0.33
CaixaBank SA, VRB	5.88%	31/12/49†	EUR	600	643,478	0.06
Spanische Staatsanleihe 144A	0.70%	30/04/32	EUR	13,676	12,748,412	1.14
Spanische Staatsanleihe 144A	2.35%	30/07/33	EUR	2,493	2,618,903	0.23
					29,253,327	2.62
ÜBERSTAATLICHE EMITTENTEN						
Africa Finance Corp	4.38%	17/04/26	USD	5,387	5,186,977	0.46
Banque Ouest Africaine de Developpement	2.75%	22/01/33	EUR	15,526	13,169,053	1.18
Europäische Union	0.40%	04/02/37	EUR	4,395	3,594,958	0.32
Europäische Union	0.45%	04/07/41	EUR	2,450	1,776,590	0.16
Europäische Union	3.38%	04/11/42	EUR	1,918	2,212,284	0.20

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
ÜBERSTAATLICHE EMITTENTEN (Fortsetzung)						
Europäische Union	2.63%	04/02/48	EUR	639	657,679	0.06
					<u>26,597,541</u>	<u>2.38</u>
SCHWEDEN						
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, VRB	2.62%	31/12/49†	EUR	246	44,562	0.00
SCHWEIZ						
UBS Group AG, VRB	7.75%	01/03/29	EUR	9,088	11,581,427	1.04
UBS Group AG, VRB	2.88%	02/04/32	EUR	5,408	5,590,828	0.50
					<u>17,172,255</u>	<u>1.54</u>
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Barclays Plc, VRB	9.25%	31/12/49†	GBP	1,190	1,515,212	0.14
Barclays Plc, VRB	8.41%	14/11/32	GBP	2,143	2,917,087	0.26
HSBC Holdings Plc, VRB	6.80%	14/09/31	GBP	3,120	4,296,088	0.38
Nationwide Building Society, VRB	5.75%	31/12/49†	GBP	980	1,155,152	0.10
NatWest Group Plc, VRB	6.00%	31/12/49†	USD	675	655,929	0.06
Staatsanleihe des Vereinigten Königreichs	1.50%	22/07/26	GBP	1,807	2,191,218	0.20
Staatsanleihe des Vereinigten Königreichs	4.75%	07/12/30	GBP	1,360	1,876,219	0.17
Staatsanleihe des Vereinigten Königreichs	3.50%	22/01/45	GBP	7,042	8,180,770	0.73
Staatsanleihe des Vereinigten Königreichs	1.25%	31/07/51	GBP	10,839	7,364,348	0.66
					<u>30,152,023</u>	<u>2.70</u>
VEREINIGTE STAATEN						
AT&T Inc	0.90%	25/03/24	USD	14,040	13,884,615	1.24
Carrier Global Corp	4.50%	29/11/32	EUR	1,970	2,330,937	0.21
Computershare US Inc	1.13%	07/10/31	EUR	5,628	4,876,880	0.44
Ford Motor Credit Co LLC	7.12%	07/11/33	USD	540	582,298	0.05
Global Payments Inc	4.88%	17/03/31	EUR	2,059	2,391,870	0.22
MPLX LP	5.00%	01/03/33	USD	1,160	1,138,514	0.10
Schatzanweisung der Vereinigten Staaten	1.13%	15/05/40	USD	16,980	10,969,345	0.98
Schatzanweisung der Vereinigten Staaten	1.25%	15/05/50	USD	29,800	16,115,281	1.44
Schatzanweisung der Vereinigten Staaten	4.13%	15/08/53	USD	2,738	2,775,862	0.25
Schatzanweisung der Vereinigten Staaten	2.50%	30/04/24	USD	42,600	42,213,106	3.78
Schatzanweisung der Vereinigten Staaten	5.00%	31/10/25	USD	22,444	22,703,509	2.03
Schatzanweisung der Vereinigten Staaten	4.63%	15/11/26	USD	5,281	5,365,991	0.48
Schatzanweisung der Vereinigten Staaten	1.63%	15/05/31	USD	39,550	33,941,934	3.04
Schatzanweisung der Vereinigten Staaten	2.75%	15/08/32	USD	10,090	9,247,327	0.83
Schatzanweisung der Vereinigten Staaten	3.50%	15/02/33	USD	5,550	5,385,668	0.48
Schatzanweisung der Vereinigten Staaten	4.50%	15/11/33	USD	2,074	2,179,158	0.20
					<u>176,102,295</u>	<u>15.77</u>
ANLEIHEN INSGESAMT					777,382,624	69.62
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt					777,382,624	69.62
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
AUSTRALIEN						
Macquarie Group Ltd 144A, VRB	6.26%	07/12/34	USD	4,050	4,238,932	0.38

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
KANADA						
Enbridge Inc, VRB	8.50%	15/01/84	USD	2,050	2,181,653	0.20
KAIMANINSELN						
Avolon Holdings Funding Ltd 144A	2.13%	21/02/26	USD	11,490	10,658,602	0.95
Avolon Holdings Funding Ltd 144A	2.75%	21/02/28	USD	2,735	2,432,230	0.22
					13,090,832	1.17
CHINA						
Chinesische Staatsanleihe	2.84%	08/04/24	CNY	296,090	41,833,849	3.75
Chinesische Staatsanleihe	3.27%	19/11/30	CNY	178,800	26,471,839	2.37
Chinesische Staatsanleihe	3.81%	14/09/50	CNY	65,470	10,784,337	0.96
					79,090,025	7.08
FRANKREICH						
Electricite de France SA 144A	6.90%	23/05/53	USD	770	874,702	0.08
Societe Generale SA, VRB	9.38%	31/12/49†	USD	1,170	1,223,564	0.11
					2,098,266	0.19
DEUTSCHLAND						
Deutsche Bank AG/New York NY, VRB	3.55%	18/09/31	USD	4,880	4,289,796	0.38
Robert Bosch GmbH	4.00%	02/06/35	EUR	2,100	2,462,250	0.22
Robert Bosch GmbH	4.38%	02/06/43	EUR	2,500	2,970,390	0.27
					9,722,436	0.87
ITALIEN						
Intesa Sanpaolo SpA	5.13%	29/08/31	EUR	2,090	2,466,492	0.22
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	7.75%	31/12/49†	EUR	3,260	3,701,556	0.33
Intesa Sanpaolo SpA 144A, VRB	8.25%	21/11/33	USD	2,550	2,777,205	0.25
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A	0.95%	01/03/37	EUR	2,995	2,318,550	0.21
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A	2.80%	01/03/67	EUR	2,141	1,732,124	0.15
					12,995,927	1.16
JAPAN						
East Japan Railway Co	4.39%	05/09/43	EUR	4,094	4,922,889	0.44
Nissan Motor Co Ltd 144A	4.81%	17/09/30	USD	5,682	5,320,340	0.48
					10,243,229	0.92
NIEDERLANDE						
Enel Finance International NV 144A	7.50%	14/10/32	USD	1,200	1,372,217	0.12
Enel Finance International NV 144A	7.75%	14/10/52	USD	700	864,984	0.08
Sartorius Finance BV	4.38%	14/09/29	EUR	1,500	1,718,777	0.15
Sartorius Finance BV	4.50%	14/09/32	EUR	1,100	1,268,193	0.11
Sartorius Finance BV	4.88%	14/09/35	EUR	1,200	1,400,664	0.13
					6,624,835	0.59
POLEN						
Polnische Staatsanleihe	3.25%	25/07/25	PLN	8,951	2,216,584	0.20

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
RUMÄNIEN						
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.88%	26/05/28	EUR	4,105	4,245,893	0.38
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.50%	08/02/30	EUR	902	865,558	0.08
Rumänische internationale Staatsanleihe	3.38%	08/02/38	EUR	1,178	1,020,611	0.09
					6,132,062	0.55
SCHWEIZ						
Credit Suisse Group AG, FTB ^{±#}	9.75%	31/12/49†	USD	2,500	300,000	0.02
UBS Group AG 144A, VRB	9.02%	15/11/33	USD	1,520	1,870,994	0.17
					2,170,994	0.19
THAILAND						
Thailändische Staatsanleihe	2.00%	17/12/31	THB	94,149	2,636,214	0.24
VEREINIGTE STAATEN						
Ally Financial Inc, VRB	6.99%	13/06/29	USD	1,870	1,935,220	0.17
Amgen Inc	5.65%	02/03/53	USD	2,265	2,389,223	0.21
Amgen Inc	5.75%	02/03/63	USD	2,030	2,138,287	0.19
Capital One Financial Corp, VRB	7.62%	30/10/31	USD	1,670	1,837,971	0.17
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	4.80%	01/03/50	USD	1,740	1,359,051	0.12
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	3.85%	01/04/61	USD	3,738	2,353,730	0.21
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	5.38%	01/05/47	USD	3,156	2,700,371	0.24
Citigroup Inc, VRB	5.61%	29/09/26	USD	6,090	6,136,647	0.55
Citigroup Inc, VRB	4.91%	24/05/33	USD	2,156	2,113,684	0.19
Columbia Pipelines Operating Co LLC 144A	5.93%	15/08/30	USD	693	718,933	0.07
Columbia Pipelines Operating Co LLC 144A	6.04%	15/11/33	USD	1,953	2,049,828	0.18
Discover Financial Services, VRB	7.96%	02/11/34	USD	2,120	2,359,833	0.21
GLP Capital LP / GLP Financing II Inc	3.25%	15/01/32	USD	1,840	1,562,146	0.14
Intel Corp	4.90%	05/08/52	USD	3,347	3,287,656	0.30
Intel Corp	5.70%	10/02/53	USD	2,258	2,447,654	0.22
Morgan Stanley, VRB	5.25%	21/04/34	USD	4,510	4,513,388	0.41
Morgan Stanley, VRB	2.48%	16/09/36	USD	4,089	3,248,266	0.29
Viatrix Inc	4.00%	22/06/50	USD	1,648	1,163,639	0.10
Wells Fargo & Co, VRB	4.90%	25/07/33	USD	5,994	5,846,496	0.52
					50,162,023	4.49
ANLEIHEN INSGESAMT					203,604,012	18.23
ANZUKÜNDIGENDE WERTPAPIERE						
VEREINIGTE STAATEN						
Fannie Mae oder Freddie Mac	5.50%	01/01/54	USD	9,190	9,238,109	0.83
Fannie Mae oder Freddie Mac	2.00%	01/01/54	USD	22,210	18,167,431	1.63
Fannie Mae oder Freddie Mac	2.50%	01/01/54	USD	14,400	12,269,251	1.10
Fannie Mae oder Freddie Mac	3.00%	01/01/54	USD	27,010	23,916,510	2.14
Fannie Mae oder Freddie Mac	6.00%	01/01/54	USD	34,160	34,715,110	3.11
Ginnie Mae	3.50%	01/01/53	USD	45,750	42,627,594	3.82
Ginnie Mae	2.50%	01/01/54	USD	8,860	7,763,852	0.70

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANZUKÜNDIGENDE WERTPAPIERE (Fortsetzung)						
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)						
Ginnie Mae	6.00%	01/01/54	USD	17,080	17,364,648	1.55
Ginnie Mae	6.50%	01/01/54	USD	12,910	13,217,004	1.18
					179,279,509	16.06
SUMME ANZUKÜNDIGENDE WERTPAPIERE					179,279,509	16.06
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt					382,883,521	34.29
Anlagen insgesamt <i>(Kosten USD 1,189,297,168)</i>					1,160,266,145	103.91
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					(43,698,812)	(3.91)
Nettovermögen insgesamt					1,116,567,333	100.00

Glossar:

FTB - Flat Trading Bond (pauschal gehandelte Anleihe)

VRB - Variable Rate Bond (variabel verzinsliche Anleihe)

Ω Wertpapier mit „Dirty Price“ bewertet

± notleidendes Wertpapier

† Unbefristete Laufzeit

^ Fälligkeitsdatum ist der 15. März 2115

Die Investition stellt eine zum beizulegenden Zeitwert bewertete Forderung dar

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.

Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
ANGOLA						
Angolanische internationale Staatsanleihe	8.00%	26/11/29	USD	665	593,446	0.10
Angolanische internationale Staatsanleihe	8.75%	14/04/32	USD	2,882	2,554,172	0.44
Angolanische internationale Staatsanleihe	9.13%	26/11/49	USD	2,651	2,177,134	0.37
					5,324,752	0.91
ARGENTINIEN						
Argentinische internationale Staatsanleihe, S/U	3.63%	09/07/35	USD	4,345	1,481,718	0.25
Argentinische internationale Staatsanleihe, S/U	3.50%	09/07/41	USD	10,948	3,740,033	0.64
YPF SA	8.50%	28/07/25	USD	122	117,496	0.02
					5,339,247	0.91
ÖSTERREICH						
Suzano Austria GmbH	3.75%	15/01/31	USD	2,036	1,790,089	0.31
BERMUDA						
Investment Energy Resources Ltd	6.25%	26/04/29	USD	571	538,373	0.09
BRITISCHE JUNGFERNINSELN						
CAS Capital No 1 Ltd, VRB	4.00%	31/12/49†	USD	2,881	2,494,316	0.43
Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd	6.13%	15/05/29	USD	2,894	2,970,872	0.51
Studio City Finance Ltd	6.50%	15/01/28	USD	577	535,888	0.09
					6,001,076	1.03
KANADA						
MEGlobal Canada ULC	5.00%	18/05/25	USD	5,295	5,244,697	0.90
KAIMANINSELN						
Alibaba Group Holding Ltd	3.25%	09/02/61	USD	1,484	938,853	0.16
China Evergrande Group †	11.50%	22/01/23 ^β	USD	4,068	61,020	0.01
DP World Crescent Ltd	5.50%	13/09/33	USD	2,890	2,963,854	0.51
IHS Holding Ltd	5.63%	29/11/26	USD	1,464	1,271,850	0.22
Kaisa Group Holdings Ltd, FTB †	8.50%	30/06/22 ^β	USD	1,265	41,112	0.01
Kaisa Group Holdings Ltd, FTB †	11.95%	22/10/22 ^β	USD	1,289	41,893	0.01
Kaisa Group Holdings Ltd, FTB †	10.88%	23/07/23 ^β	USD	2,363	76,797	0.01
Kaisa Group Holdings Ltd †	9.75%	28/09/23 ^β	USD	200	6,500	0.00
Lamar Funding Ltd	3.96%	07/05/25	USD	5,783	5,651,495	0.97
Meituan	2.13%	28/10/25	USD	320	301,680	0.05
Melco Resorts Finance Ltd	5.75%	21/07/28	USD	1,344	1,245,090	0.21
Melco Resorts Finance Ltd	5.38%	04/12/29	USD	914	807,747	0.14
Zhenro Properties Group Ltd †	9.15%	06/05/23 ^β	USD	390	3,900	0.00
					13,411,791	2.30
CHILE						
Chilenische internationale Staatsanleihe	1.25%	22/01/51	EUR	4,378	2,722,225	0.47
Chilenische internationale Staatsanleihe	5.33%	05/01/54	USD	4,938	4,923,340	0.84
Corp. Nacional del Cobre de Chile	5.95%	08/01/34	USD	1,517	1,540,119	0.26
Corp. Nacional del Cobre de Chile	6.30%	08/09/53	USD	2,730	2,769,858	0.48
					11,955,542	2.05

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
KOLUMBIEN						
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	3.88%	22/03/26	EUR	2,779	3,040,183	0.52
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	3.25%	22/04/32	USD	5,219	4,164,599	0.71
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	4.13%	22/02/42	USD	1,537	1,102,317	0.19
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	8.75%	14/11/53	USD	1,885	2,170,990	0.37
Ecopetrol SA	8.88%	13/01/33	USD	2,567	2,791,613	0.48
Ecopetrol SA	5.88%	02/11/51	USD	2,040	1,551,675	0.27
					14,821,377	2.54
COSTA RICA						
Costa-ricanische internationale Staatsanleihe	7.30%	13/11/54	USD	3,410	3,710,114	0.64
DOMINIKANISCHE REPUBLIK						
Dominikanische internationale Staatsanleihe	5.50%	27/01/25	USD	8,372	8,344,582	1.43
Dominikanische internationale Staatsanleihe	5.95%	25/01/27	USD	2,895	2,911,154	0.50
Dominikanische internationale Staatsanleihe	4.50%	30/01/30	USD	2,346	2,163,452	0.37
Dominikanische internationale Staatsanleihe	4.88%	23/09/32	USD	2,659	2,426,444	0.42
					15,845,632	2.72
ECUADOR						
Ecuadorianische internationale Staatsanleihe, S/U	3.50%	31/07/35	USD	4,752	1,708,169	0.29
ÄGYPTEN						
Ägyptische internationale Staatsanleihe	5.25%	06/10/25	USD	2,102	1,928,585	0.33
Ägyptische internationale Staatsanleihe	5.88%	16/02/31	USD	1,082	711,922	0.12
Ägyptische internationale Staatsanleihe	7.05%	15/01/32	USD	887	610,367	0.10
Ägyptische internationale Staatsanleihe	7.63%	29/05/32	USD	2,014	1,405,080	0.24
Ägyptische internationale Staatsanleihe	7.30%	30/09/33	USD	706	468,608	0.08
Ägyptische internationale Staatsanleihe	8.70%	01/03/49	USD	3,700	2,328,687	0.40
Ägyptische internationale Staatsanleihe	7.50%	16/02/61	USD	7,418	4,353,439	0.75
					11,806,688	2.02
EL SALVADOR						
Internationale Staatsanleihe El Salvador	7.65%	15/06/35	USD	1,773	1,389,035	0.24
Internationale Staatsanleihe El Salvador	7.63%	01/02/41	USD	1,058	796,145	0.14
Internationale Staatsanleihe El Salvador	7.12%	20/01/50	USD	1,846	1,314,986	0.22
					3,500,166	0.60

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
GHANA						
Ghanaische internationale Staatsanleihe	10.75%	14/10/30	USD	219	138,791	0.02
HONGKONG						
Airport Authority, VRB	2.10%	31/12/49†	USD	1,322	1,234,629	0.21
Airport Authority, VRB	2.40%	31/12/49†	USD	2,219	1,977,817	0.34
					3,212,446	0.55
INDIEN						
Adani International Container Terminal Pvt Ltd	3.00%	16/02/31	USD	1,061	876,126	0.15
Shriram Finance Ltd	4.40%	13/03/24	USD	4,139	4,109,820	0.70
Shriram Finance Ltd	4.15%	18/07/25	USD	1,063	1,024,466	0.18
					6,010,412	1.03
INDONESIEN						
Indonesische internationale Staatsanleihe	4.30%	31/03/52	USD	2,309	2,102,994	0.36
Indonesische internationale Staatsanleihe	3.35%	12/03/71	USD	872	641,329	0.11
					2,744,323	0.47
IRAK						
Irakische internationale Staatsanleihe	5.80%	15/01/28	USD	3,004	2,818,362	0.48
INSEL MAN						
Gohl Capital Ltd	4.25%	24/01/27	USD	4,457	4,282,898	0.73
ISRAEL						
Bank Hapoalim BM 144A, VRB	3.26%	21/01/32	USD	3,932	3,414,082	0.58
Bank Leumi Le-Israel BM 144A, VRB	7.13%	18/07/33	USD	1,923	1,898,963	0.33
Leviathan Bond Ltd 144A	6.50%	30/06/27	USD	1,941	1,834,395	0.31
					7,147,440	1.22
JERSEY						
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd	2.63%	31/03/36	USD	11,008	9,110,840	1.56
KENIA						
Kenianische internationale Staatsanleihe	6.88%	24/06/24	USD	814	793,523	0.14
LIBANON						
Libanesische internationale Staatsanleihe †	6.38%	09/03/20 ^β	USD	4,106	256,625	0.04
Libanesische internationale Staatsanleihe †	5.80%	14/04/20 ^β	USD	164	10,250	0.00
Libanesische internationale Staatsanleihe †	6.15%	19/06/20 ^β	USD	1,949	121,813	0.02
Libanesische internationale Staatsanleihe †	8.25%	12/04/21 ^β	USD	583	36,255	0.01
Libanesische internationale Staatsanleihe †	6.10%	04/10/22 ^β	USD	795	49,563	0.01

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
LIBANON (Fortsetzung)						
Libanesische internationale Staatsanleihe ‡	8.25%	17/05/34	USD	295	18,438	0.00
					492,944	0.08
LUXEMBURG						
Aegea Finance Sarl	6.75%	20/05/29	USD	1,062	1,040,691	0.18
Chile Electricity Lux MPC Sarl	6.01%	20/01/33	USD	1,629	1,680,161	0.29
Greensaif Pipelines Bidco Sarl	6.51%	23/02/42	USD	1,892	1,997,538	0.34
Minerva Luxembourg SA	4.38%	18/03/31	USD	539	445,777	0.07
					5,164,167	0.88
MAURITIUS						
Greenko Power II Ltd	4.30%	13/12/28	USD	1,913	1,742,766	0.30
MEXIKO						
America Movil SAB de CV	4.38%	22/04/49	USD	2,087	1,857,430	0.32
Braskem Idesa SAPI	7.45%	15/11/29	USD	1,311	815,704	0.14
Mexico City Airport Trust	5.50%	31/07/47	USD	3,678	3,182,132	0.54
Mexikanische internationale Staatsanleihe	6.34%	04/05/53	USD	4,057	4,145,113	0.71
Mexikanische internationale Staatsanleihe	3.77%	24/05/61	USD	2,707	1,841,606	0.32
Petroleos Mexicanos	2.75%	21/04/27	EUR	1,865	1,739,166	0.30
Petroleos Mexicanos	6.75%	21/09/47	USD	5,166	3,392,771	0.58
					16,973,922	2.91
MAROKKO						
Marokkanische internationale Staatsanleihe	4.00%	15/12/50	USD	1,535	1,109,038	0.19
NIEDERLANDE						
Braskem Netherlands Finance BV	7.25%	13/02/33	USD	792	665,280	0.11
Metinvest BV	7.65%	01/10/27	USD	2,654	1,725,100	0.30
Metinvest BV	7.75%	17/10/29	USD	703	428,830	0.07
MV24 Capital BV	6.75%	01/06/34	USD	2,131	1,993,619	0.34
Prosus NV	1.99%	13/07/33	EUR	1,607	1,316,068	0.23
Prosus NV	3.83%	08/02/51	USD	1,519	962,666	0.16
Royal Capital BV, VRB	5.00%	31/12/49†	USD	642	628,157	0.11
					7,719,720	1.32
NIGERIA						
Nigerianische internationale Staatsanleihe	6.13%	28/09/28	USD	2,309	2,054,289	0.35
Nigerianische internationale Staatsanleihe	7.38%	28/09/33	USD	4,540	3,885,956	0.67
					5,940,245	1.02
NORDMAZEDONIEN						
Nordmazedonische internationale Staatsanleihe	6.96%	13/03/27	EUR	2,781	3,214,482	0.55
OMAN						
Omanische internationale Staatsanleihe	4.75%	15/06/26	USD	3,000	2,970,000	0.51
Omanische internationale Staatsanleihe	6.25%	25/01/31	USD	2,149	2,264,845	0.39

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
OMAN (Fortsetzung)						
Omanische internationale Staatsanleihe	6.50%	08/03/47	USD	5,401	5,527,329	0.95
Omanische internationale Staatsanleihe	6.75%	17/01/48	USD	1,036	1,086,667	0.18
Omanische internationale Staatsanleihe	7.00%	25/01/51	USD	1,472	1,592,290	0.27
					13,441,131	2.30
PAKISTAN						
Pakistanische internationale Staatsanleihe	6.00%	08/04/26	USD	2,824	2,009,011	0.35
Pakistanische internationale Staatsanleihe	7.38%	08/04/31	USD	5,052	3,103,033	0.53
					5,112,044	0.88
PARAGUAY						
Paraguayische internationale Staatsanleihe	5.40%	30/03/50	USD	1,368	1,224,702	0.21
PHILIPPINEN						
ROP Sukuk Trust	5.05%	06/06/29	USD	4,100	4,178,156	0.72
POLEN						
Bank Gospodarstwa Krajowego	5.38%	22/05/33	USD	2,412	2,451,075	0.42
Polnische internationale Staatsanleihe	5.50%	04/04/53	USD	2,352	2,461,109	0.42
					4,912,184	0.84
KATAR						
Katarische internationale Staatsanleihe	4.82%	14/03/49	USD	1,760	1,717,628	0.29
Katarische internationale Staatsanleihe	4.40%	16/04/50	USD	4,298	3,982,871	0.68
QatarEnergy	3.13%	12/07/41	USD	2,918	2,251,295	0.39
QatarEnergy	3.30%	12/07/51	USD	3,747	2,745,670	0.47
					10,697,464	1.83
RUMÄNIEN						
Rumänische internationale Staatsanleihe	5.50%	18/09/28	EUR	3,659	4,163,657	0.72
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.63%	02/12/40	EUR	9,860	7,351,072	1.26
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.75%	14/04/41	EUR	3,785	2,814,988	0.48
					14,329,717	2.46
SERBIEN						
Serbische internationale Anleihe	1.50%	26/06/29	EUR	5,120	4,795,531	0.82
Serbische internationale Anleihe	6.50%	26/09/33	USD	7,829	8,042,654	1.38
					12,838,185	2.20
SINGAPUR						
BOC Aviation Ltd	4.50%	23/05/28	USD	1,506	1,475,323	0.25

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
SÜDAFRIKA						
Eskom Holdings SOC Ltd	7.13%	11/02/25	USD	1,051	1,053,135	0.18
Südafrikanische internationale Staatsanleihe	4.30%	12/10/28	USD	1,746	1,637,966	0.28
Südafrikanische internationale Staatsanleihe	4.85%	30/09/29	USD	3,246	3,053,776	0.52
Südafrikanische internationale Staatsanleihe	5.00%	12/10/46	USD	1,670	1,238,931	0.21
Südafrikanische internationale Staatsanleihe	5.75%	30/09/49	USD	1,585	1,269,966	0.22
					8,253,774	1.41
SRI LANKA						
Sri-lankische internationale Staatsanleihe, FTB †	6.85%	14/03/24	USD	2,631	1,340,166	0.23
Sri-lankische internationale Staatsanleihe, FTB †	6.35%	28/06/24	USD	569	290,012	0.05
Sri-lankische internationale Staatsanleihe, FTB †	6.85%	03/11/25	USD	1,360	701,037	0.12
Sri-lankische internationale Staatsanleihe, FTB †	6.20%	11/05/27	USD	250	126,797	0.02
					2,458,012	0.42
ÜBERSTAATLICHE EMITTENTEN						
African Export-Import Bank	3.99%	21/09/29	USD	383	341,887	0.06
THAILAND						
Bangkok Bank PCL/Hong Kong, VRB	3.47%	23/09/36	USD	2,097	1,759,572	0.30
TUNESIEN						
Tunesische Republik	5.63%	17/02/24	EUR	7,258	7,772,293	1.33
Tunesische Republik	5.75%	30/01/25	USD	3,519	2,893,278	0.50
					10,665,571	1.83
TÜRKEI						
Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS	8.51%	14/01/29	USD	3,180	3,380,340	0.58
Istanbul Metropolitan Municipality	10.50%	06/12/28	USD	2,040	2,172,804	0.37
Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği AS	8.25%	15/11/28	USD	2,640	2,765,136	0.47
Türk Telekomunikasyon AS	4.88%	19/06/24	USD	417	412,724	0.07
Turkcell İletişim Hizmetleri AS	5.75%	15/10/25	USD	1,057	1,043,121	0.18
Türkische internationale Staatsanleihe	4.88%	16/04/43	USD	7,262	5,324,317	0.91
Türkische internationale Staatsanleihe	5.75%	11/05/47	USD	10,260	8,041,275	1.38
Türkiye İhracat Kredi Bankası AS	9.00%	28/01/27	USD	2,020	2,108,691	0.36
Türkiye Vakıflar Bankası Tao	9.00%	12/10/28	USD	1,520	1,598,850	0.28
Ziraat Katılım Varlik Kiralama AS	9.38%	12/11/26	USD	2,080	2,194,725	0.38
					29,041,983	4.98
UKRAINE						
Ukrainische internationale Staatsanleihe, FTB †	7.38%	25/09/34	USD	8,292	1,979,715	0.34
Ukrainische internationale Staatsanleihe, FRB †	7.75%	01/08/41	USD	9,884	4,450,666	0.76
					6,430,381	1.10

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE						
Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	3.50%	31/03/27	USD	2,638	2,510,222	0.43
Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	4.50%	14/09/27	USD	2,859	2,807,627	0.48
Abu Dhabi internationale Staatsanleihe	3.88%	16/04/50	USD	357	300,184	0.05
Abu Dhabi internationale Staatsanleihe	2.70%	02/09/70	USD	2,326	1,479,278	0.25
Finanzministerium Sharjah	4.00%	28/07/50	USD	6,754	4,525,180	0.78
First Abu Dhabi Bank PJSC, VRB	6.32%	04/04/34	USD	3,390	3,501,234	0.60
MDGH GMTN RSC Ltd	4.38%	22/11/33	USD	1,280	1,248,851	0.22
Nbk Tier 2 Ltd, VRB	2.50%	24/11/30	USD	2,806	2,631,940	0.45
					19,004,516	3.26
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Antofagasta Plc	5.63%	13/05/32	USD	3,033	3,028,735	0.52
Bidvest Group UK Plc	3.63%	23/09/26	USD	4,001	3,720,305	0.64
Standard Chartered Plc, VRB	7.78%	16/11/25	USD	4,820	4,911,845	0.84
Standard Chartered Plc, VRB	4.64%	01/04/31	USD	2,144	2,022,800	0.35
Tullow Oil Plc	10.25%	15/05/26	USD	413	369,183	0.06
Vedanta Resources Finance II Plc	8.95%	11/03/25	USD	787	590,411	0.10
					14,643,279	2.51
VEREINIGTE STAATEN						
Kosmos Energy Ltd	7.50%	01/03/28	USD	1,772	1,625,810	0.28
Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc	4.63%	06/04/31	USD	2,700	2,220,750	0.38
Stillwater Mining Co	4.00%	16/11/26	USD	6,125	5,451,250	0.93
Stillwater Mining Co	4.50%	16/11/29	USD	3,286	2,604,155	0.45
Schatzanweisung der Vereinigten Staaten	0.88%	31/01/24	USD	33,397	33,279,107	5.70
					45,181,072	7.74
URUGUAY						
Uruguayische internationale Staatsanleihe	5.75%	28/10/34	USD	5,480	5,947,009	1.02
USBEKISTAN						
Usbekische internationale Staatsanleihe	3.90%	19/10/31	USD	1,976	1,662,928	0.28
Uzbekneftegaz JSC	4.75%	16/11/28	USD	838	699,337	0.12
					2,362,265	0.40
VENEZUELA						
Petroleos de Venezuela SA *	8.50%	27/10/20 ^β	USD	275	218,883	0.04
Venezolanische internationale Staatsanleihe *	7.75%	13/10/19 ^β	USD	85	11,807	0.00
Venezolanische internationale Staatsanleihe *	8.25%	13/10/24	USD	158	23,700	0.01
Venezolanische internationale Staatsanleihe *	11.75%	21/10/26	USD	2,900	546,015	0.09
					800,405	0.14
SAMBIA						
Sambische internationale Staatsanleihe, FTB *	5.38%	20/09/22 ^β	USD	3,172	1,783,647	0.31
ANLEIHEN INSGESAMT					396,496,311	67.93

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
KURZFRISTIGE ANLEIHEN						
KAIMANINSELN						
Kaisa Group Holdings Ltd, FTB †	10.50%	07/09/22 ^β	USD	209	6,151	0.00
Zhenro Properties Group Ltd †	8.00%	06/03/23 ^β	USD	2,575	32,188	0.01
					38,339	0.01
KURZFRISTIGE ANLEIHEN INSGESAMT					38,339	0.01
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt					396,534,650	67.94
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
ARGENTINIEN						
Provincia de Buenos Aires, S/U	6.38%	01/09/37	USD	3,910	1,513,038	0.26
YPF SA	8.50%	23/03/25	USD	957	924,487	0.16
YPF SA	6.95%	21/07/27	USD	884	787,684	0.13
					3,225,209	0.55
ÖSTERREICH						
Klabin Austria GmbH	3.20%	12/01/31	USD	1,562	1,301,341	0.22
BRASILIEN						
Brasilianische internationale Staatsanleihe	6.25%	18/03/31	USD	4,440	4,615,269	0.79
Samarco Mineracao SA, PIK	9.50%	30/06/31	USD	15,864	13,311,957	2.28
					17,927,226	3.07
BRITISCHE JUNGFERNINSELN						
Studio City Finance Ltd	6.00%	15/07/25	USD	731	718,208	0.12
KANADA						
Canacol Energy Ltd	5.75%	24/11/28	USD	1,348	988,077	0.17
First Quantum Minerals Ltd	6.88%	15/10/27	USD	1,289	1,100,568	0.19
					2,088,645	0.36
KAIMANINSELN						
China Evergrande Group †	8.75%	28/06/25	USD	1,331	19,965	0.00
Kaisa Group Holdings Ltd, FTB †	10.88%	31/12/49†	USD	256	6,400	0.00
Kaisa Group Holdings Ltd, FTB †	11.50%	30/01/23 ^β	USD	487	15,828	0.00
Kaisa Group Holdings Ltd †	9.38%	30/06/24	USD	634	20,605	0.01
MGM China Holdings Ltd	4.75%	01/02/27	USD	502	478,704	0.08
Rutas 2 & 7 Finance Ltd	0.00%	30/09/36	USD	1,179	778,104	0.13
Sands China Ltd	4.30%	08/01/26	USD	580	559,156	0.10
Sands China Ltd	5.65%	08/08/28	USD	502	497,105	0.09
Zhenro Properties Group Ltd †	8.30%	15/09/23 ^β	USD	330	3,300	0.00
Zhenro Properties Group Ltd †	6.63%	07/01/26	USD	205	2,050	0.00
Zhenro Properties Group Ltd †	6.70%	04/08/26	USD	1,837	18,370	0.00
					2,399,587	0.41
CHILE						
CAP SA	3.90%	27/04/31	USD	1,330	1,024,280	0.18
Inversiones CMPC SA	4.38%	04/04/27	USD	2,781	2,704,088	0.46
Inversiones CMPC SA	3.00%	06/04/31	USD	1,038	885,544	0.15
Telefonica Moviles Chile SA	3.54%	18/11/31	USD	2,490	1,851,159	0.32
					6,465,071	1.11

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
KOLUMBIEN						
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	3.00%	30/01/30	USD	5,645	4,764,733	0.82
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	7.50%	02/02/34	USD	5,420	5,729,956	0.98
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	8.00%	14/11/35	USD	5,368	5,882,154	1.01
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	3.88%	15/02/61	USD	6,248	3,910,857	0.67
					20,287,700	3.48
GUATEMALA						
CT Trust	5.13%	03/02/32	USD	2,286	1,997,038	0.34
Guatemaltekkische Staatsanleihe	7.05%	04/10/32	USD	380	405,175	0.07
Guatemaltekkische Staatsanleihe	3.70%	07/10/33	USD	3,200	2,675,200	0.46
					5,077,413	0.87
HONGKONG						
Huaxin Cement International Finance Co Ltd	2.25%	19/11/25	USD	1,645	1,514,806	0.26
INDONESIEN						
Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	3.40%	09/06/31	USD	1,384	1,200,404	0.20
ISRAEL						
Bank Leumi Le-Israel BM 144A	5.13%	27/07/27	USD	2,721	2,681,035	0.46
Mizrahi Tefahot Bank Ltd 144A, VRB	3.08%	07/04/31	USD	8,141	7,225,138	1.24
					9,906,173	1.70
LUXEMBURG						
Aegea Finance Sarl	9.00%	20/01/31	USD	2,620	2,799,732	0.48
Millicom International Cellular SA	4.50%	27/04/31	USD	1,588	1,325,583	0.23
Minerva Luxembourg SA	8.88%	13/09/33	USD	1,591	1,690,613	0.29
					5,815,928	1.00
MEXIKO						
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand, VRB	7.53%	01/10/28	USD	200	209,690	0.04
BBVA Bancomer SA/Texas, VRB	5.88%	13/09/34	USD	1,360	1,275,047	0.22
BBVA Bancomer SA/Texas, VRB	8.45%	29/06/38	USD	3,364	3,578,119	0.61
Petroleos Mexicanos	8.75%	02/06/29	USD	1,458	1,410,251	0.24
Petroleos Mexicanos	5.63%	23/01/46	USD	6,310	3,844,367	0.66
Petroleos Mexicanos	7.69%	23/01/50	USD	1,067	762,905	0.13
Petroleos Mexicanos	6.95%	28/01/60	USD	5,265	3,474,900	0.59
					14,555,279	2.49
NIEDERLANDE						
Braskem Netherlands Finance BV, VRB	8.50%	23/01/81	USD	475	415,625	0.07
Embraer Netherlands Finance BV	7.00%	28/07/30	USD	4,085	4,286,493	0.73
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	7.88%	15/09/29	USD	643	694,356	0.12

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
NIEDERLANDE (Fortsetzung)						
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	8.13%	15/09/31	USD	676	738,091	0.13
					6,134,565	1.05
PANAMA						
Banco General SA	4.13%	07/08/27	USD	1,638	1,537,672	0.26
Panamaische internationale Staatsanleihe	4.50%	01/04/56	USD	6,562	4,426,274	0.76
Panamaische internationale Staatsanleihe	3.87%	23/07/60	USD	10,335	6,212,304	1.07
					12,176,250	2.09
PARAGUAY						
Banco Continental SAECA	2.75%	10/12/25	USD	4,276	4,003,042	0.69
Paraguayische internationale Staatsanleihe	2.74%	29/01/33	USD	3,962	3,263,697	0.56
Telefonica Celular del Paraguay SA	5.88%	15/04/27	USD	3,704	3,630,457	0.62
					10,897,196	1.87
PERU						
Banco de Credito del Peru SA, VRB	3.13%	01/07/30	USD	1,361	1,289,745	0.22
Compania de Minas Buenaventura SAA	5.50%	23/07/26	USD	1,515	1,454,839	0.25
Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru	8.55%	18/09/33	USD	770	835,858	0.15
InRetail Consumer	3.25%	22/03/28	USD	1,779	1,591,371	0.27
					5,171,813	0.89
PHILIPPINEN						
Philippinische internationale Staatsanleihe	5.00%	17/07/33	USD	2,220	2,287,294	0.39
SINGAPUR						
Continuum Energy Levanter Pte Ltd	4.50%	09/02/27	USD	1,990	1,883,190	0.32
Medco Maple Tree Pte Ltd	8.96%	27/04/29	USD	2,710	2,770,975	0.48
					4,654,165	0.80
SÜDKOREA						
LG Energy Solution Ltd	5.63%	25/09/26	USD	2,860	2,891,246	0.49
LG Energy Solution Ltd	5.75%	25/09/28	USD	1,640	1,686,010	0.29
POSCO	5.75%	17/01/28	USD	636	651,792	0.11
					5,229,048	0.89
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE						
MDGH GMTN RSC Ltd	5.08%	22/05/53	USD	360	354,098	0.06
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Avianca Midco 2 Plc 144A	9.00%	01/12/28	USD	1,629	1,433,520	0.25
Endeavour Mining Plc	5.00%	14/10/26	USD	1,097	1,017,125	0.17
					2,450,645	0.42
VEREINIGTE STAATEN						
Azul Secured Finance LLP	11.93%	28/08/28	USD	933	967,259	0.17

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)						
BOC Aviation USA Corp	4.88%	03/05/33	USD	961	940,156	0.16
DAE Funding LLC	2.63%	20/03/25	USD	5,979	5,751,619	0.98
SierraCol Energy Andina LLC	6.00%	15/06/28	USD	477	399,592	0.07
					8,058,626	1.38
URUGUAY						
Uruguayische internationale Staatsanleihe	4.38%	23/01/31	USD	1,403	1,392,498	0.24
Uruguayische internationale Staatsanleihe	4.98%	20/04/55	USD	1,724	1,687,414	0.29
					3,079,912	0.53
VENEZUELA						
Petroleos de Venezuela SA †	6.00%	15/11/26	USD	111	12,713	0.00
					152,989,315	26.21
ANLEIHEN INSGESAMT					152,989,315	26.21
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt					152,989,315	26.21
Sonstige Wertpapiere						
ANLEIHEN						
BERMUDA						
Digicel Group Holdings Ltd †	0.00%	31/12/30	USD	588	323,476	0.05
Digicel Group Holdings Ltd †	0.00%	31/12/30	USD	1,325	99,368	0.02
Digicel Group Holdings Ltd †	0.00%	31/12/30	USD	5	2,869	0.00
Digicel Group Holdings Ltd †	0.00%	31/12/30	USD	237	7,097	0.00
					432,810	0.07
MULTINATIONAL						
Digicel International Finance Ltd/Digicel international Holdings Ltd	8.75%	25/05/24	USD	2,151	2,016,346	0.35
					2,449,156	0.42
ANLEIHEN INSGESAMT					2,449,156	0.42
STAMMAKTIE						
LUXEMBURG						
Drillco Holding Lux SA			USD	14	339,075	0.06
Drillco Holding Lux SA			USD	2	37,675	0.00
					376,750	0.06
STAMMAKTIE INSGESAMT					376,750	0.06
Sonstige Wertpapiere insgesamt					2,825,906	0.48

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Anlagen insgesamt <i>(Kosten USD 563,815,110)</i>	552,349,871	94.63
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten	31,309,573	5.37
Nettovermögen insgesamt	583,659,444	100.00

Glossar:

FTB - Flat Trading Bond (pauschal gehandelte Anleihe)

FRB - Floating Rate Bond (Anleihe mit variablem Zins)

PIK - Payment-in-Kind (Sachleistung)

S/U - Step Up Bond

VRB - Variable Rate Bond (variabel verzinsliche Anleihe)

± notleidendes Wertpapier

† Unbefristete Laufzeit

β Die Anlage stellt ein offenstehendes Geschäft nach dem Fälligkeitsdatum dar

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.
Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.
Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
GRIECHENLAND						
Griechische Staatsanleihe 144A	4.25%	15/06/33	EUR	5,732	6,951,201	1.45
Griechische Staatsanleihe 144A	4.38%	18/07/38	EUR	26,716	32,542,180	6.75
					39,493,381	8.20
ISLAND						
Iceland Rikisbref	4.50%	17/02/42	ISK	2,306,432	13,680,128	2.84
MEXIKO						
Mexikanische Anleihen	5.50%	04/03/27	MXN	1,583,100	83,656,241	17.36
Mexikanische Anleihen	8.50%	01/03/29	MXN	705,100	40,673,417	8.44
Mexikanische Anleihen	8.50%	31/05/29	MXN	218,290	12,641,730	2.62
Mexikanische Anleihen	7.50%	26/05/33	MXN	714,600	38,378,761	7.96
					175,350,149	36.38
OMAN						
Omanische internationale Staatsanleihe	6.25%	25/01/31	USD	11,623	12,249,552	2.54
Omanische internationale Staatsanleihe	7.00%	25/01/51	USD	10,345	11,190,381	2.32
					23,439,933	4.86
RUMÄNIEN						
Rumänische internationale Staatsanleihe	6.63%	17/02/28	USD	3,990	4,130,408	0.86
Rumänische internationale Staatsanleihe	3.62%	26/05/30	EUR	818	832,314	0.17
Rumänische internationale Staatsanleihe	1.75%	13/07/30	EUR	10,384	9,309,035	1.93
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.00%	28/01/32	EUR	2,247	1,922,623	0.40
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.00%	14/04/33	EUR	17,468	14,423,779	2.99
Rumänische internationale Staatsanleihe	3.88%	29/10/35	EUR	2,252	2,123,178	0.44
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.75%	14/04/41	EUR	24,104	17,926,679	3.72
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.88%	13/04/42	EUR	13,545	10,168,803	2.11
Rumänische internationale Staatsanleihe	4.63%	03/04/49	EUR	12,913	12,004,659	2.49
Rumänische internationale Staatsanleihe	3.38%	28/01/50	EUR	20,592	15,548,793	3.23
					88,390,271	18.34
SÜDAFRIKA						
Südafrikanische Staatsanleihe	8.00%	31/01/30	ZAR	388,863	19,575,075	4.06
Südafrikanische Staatsanleihe	8.88%	28/02/35	ZAR	556,295	25,688,682	5.33
Südafrikanische Staatsanleihe	8.50%	31/01/37	ZAR	299,616	12,786,320	2.66
					58,050,077	12.05
ANLEIHEN INSGESAMT					398,403,939	82.67

BlueBay Funds – BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
SÜDAFRIKA (Fortsetzung)						
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt					398,403,939	82.67
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
RUMÄNIEN						
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.88%	26/05/28	EUR	3,520	3,639,765	0.76
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.50%	08/02/30	EUR	1,264	1,212,995	0.25
Rumänische internationale Staatsanleihe	3.38%	08/02/38	EUR	417	361,466	0.07
					5,214,226	1.08
ANLEIHEN INSGESAMT					5,214,226	1.08
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt					5,214,226	1.08
Anlagen insgesamt <i>(Kosten USD 402,994,248)</i>					403,618,165	83.75
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					78,344,790	16.25
Nettovermögen insgesamt					481,962,955	100.00

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.
Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.
Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
ÖSTERREICH						
Benteler International AG	9.38%	15/05/28	EUR	1,515	1,793,764	0.37
DÄNEMARK						
TDC Net A/S	6.50%	01/06/31	EUR	1,531	1,792,576	0.37
FINNLAND						
SBB Treasury OYJ, FRB	4.51%	08/02/24	EUR	766	838,699	0.18
FRANKREICH						
Altice France SA/France	5.88%	01/02/27	EUR	543	536,762	0.11
Altice France SA/France 144A	5.13%	15/07/29	USD	1,721	1,341,277	0.28
Banjay Group SAS	6.50%	01/03/26	EUR	907	1,003,466	0.21
BNP Paribas SA 144A, VRB	7.75%	31/12/49†	USD	1,559	1,595,278	0.33
CAB SELAS	3.38%	01/02/28	EUR	1,710	1,688,437	0.35
Forvia SE	7.25%	15/06/26	EUR	1,450	1,701,964	0.35
Loxam SAS	4.50%	15/02/27	EUR	2,113	2,337,440	0.49
					10,204,624	2.12
DEUTSCHLAND						
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	7.50%	15/05/30	EUR	3,150	3,715,957	0.77
Cheplapharm Arzneimittel GmbH 144A	5.50%	15/01/28	USD	3,412	3,230,013	0.67
Deutsche Bank AG, VRB	10.00%	31/12/49†	EUR	1,200	1,449,829	0.30
IHO Verwaltungs GmbH, PIK	3.88%	15/05/27	EUR	2,574	2,792,470	0.58
IHO Verwaltungs GmbH, PIK	8.75%	15/05/28	EUR	2,705	3,262,503	0.68
Nidda Healthcare Holding GmbH	7.50%	21/08/26	EUR	872	994,547	0.20
Novelis Sheet Ingot GmbH	3.38%	15/04/29	EUR	2,436	2,547,243	0.53
					17,992,562	3.73
ITALIEN						
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	10.50%	23/07/29	EUR	553	672,396	0.14
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	9.13%	31/12/49†	EUR	2,385	2,905,379	0.60
Telecom Italia SpA/Milano	6.88%	15/02/28	EUR	2,713	3,199,333	0.66
Telecom Italia SpA/Milano	7.88%	31/07/28	EUR	1,668	2,052,055	0.43
UniCredit SpA, VRB	4.45%	31/12/49†	EUR	2,739	2,698,852	0.56
					11,528,015	2.39
JERSEY						
Avis Budget Finance Plc	7.25%	31/07/30	EUR	2,181	2,586,191	0.54
LUXEMBURG						
Aegea Finance Sarl	6.75%	20/05/29	USD	2,519	2,477,334	0.51
Altice Financing SA	3.00%	15/01/28	EUR	566	560,208	0.12
Altice Financing SA 144A	5.75%	15/08/29	USD	1,577	1,401,548	0.29
Altice France Holding SA	8.00%	15/05/27	EUR	1,234	786,848	0.16
Cidron Aida Finco Sarl	5.00%	01/04/28	EUR	1,831	1,953,326	0.40
Cidron Aida Finco Sarl	6.25%	01/04/28	GBP	1,399	1,687,977	0.35
Cullinan Holdco Scsp	4.63%	15/10/26	EUR	1,768	1,526,677	0.32
Dana Financing Luxembourg Sarl	8.50%	15/07/31	EUR	1,972	2,390,227	0.50
Matterhorn Telecom SA	3.13%	15/09/26	EUR	3,151	3,378,495	0.70
					16,162,640	3.35
MULTINATIONAL						
Clarios Global LP / Clarios US Finance Co	4.38%	15/05/26	EUR	1,657	1,821,187	0.38

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
MULTINATIONAL (Fortsetzung)						
GEMS MENASA Cayman Ltd / GEMS Education Delaware LLC 144A	7.13%	31/07/26	USD	3,743	3,687,379	0.76
Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co.-Issuer, Inc. 144A, PIK	7.63%	15/10/25	USD	1,890	1,923,025	0.40
					7,431,591	1.54
NIEDERLANDE						
GTCR W-2 Merger Sub LLC / GTCR W Dutch Finance Sub BV	8.50%	15/01/31	GBP	1,474	2,037,365	0.42
Telefonica Europe BV, VRB	2.38%	31/12/49†	EUR	3,300	3,175,912	0.66
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	7.38%	15/09/29	EUR	1,554	1,883,123	0.39
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	7.88%	15/09/31	EUR	1,734	2,176,204	0.45
United Group BV	3.63%	15/02/28	EUR	1,709	1,755,217	0.36
United Group BV	5.25%	01/02/30	EUR	1,718	1,803,905	0.37
UPC Holding BV	3.88%	15/06/29	EUR	2,518	2,587,521	0.54
Ziggo Bond Co BV	3.38%	28/02/30	EUR	2,448	2,292,214	0.48
					17,711,461	3.67
SPANIEN						
Banco de Sabadell SA, VRB	9.38%	31/12/49†	EUR	600	710,570	0.15
Banco de Sabadell SA, VRB	5.75%	31/12/49†	EUR	1,000	1,049,853	0.22
Banco Santander SA, VRB	3.63%	31/12/49†	EUR	4,000	3,313,106	0.68
CaixaBank SA, VRB	3.63%	31/12/49†	EUR	2,000	1,711,025	0.35
Ibercaja Banco SA, VRB	2.75%	23/07/30	EUR	1,400	1,483,714	0.31
Kaixo Bondco Telecom SA	5.13%	30/09/29	EUR	3,147	3,267,753	0.68
Lorca Telecom Bondco SA	4.00%	18/09/27	EUR	1,247	1,348,220	0.28
					12,884,241	2.67
SCHWEDEN						
Verisure Holding AB	3.88%	15/07/26	EUR	2,264	2,461,676	0.51
Verisure Holding AB	9.25%	15/10/27	EUR	2,426	2,886,371	0.60
					5,348,047	1.11
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Barclays Plc, VRB	8.00%	31/12/49†	USD	1,670	1,643,133	0.34
Barclays Plc, VRB	7.13%	31/12/49†	GBP	1,727	2,146,833	0.45
Bellis Acquisition Co. Plc	3.25%	16/02/26	GBP	1,398	1,658,231	0.34
Bellis Acquisition Co. Plc	4.50%	16/02/26	GBP	658	796,160	0.17
Co-operative Group Holdings 2011 Ltd, S/U	7.50%	08/07/26	GBP	1,247	1,572,182	0.33
Heathrow Finance Plc	5.75%	03/03/25	GBP	1,681	2,133,563	0.44
Jaguar Land Rover Automotive Plc	4.50%	15/07/28	EUR	2,516	2,722,532	0.56
Jerrold Finco Plc	5.25%	15/01/27	GBP	1,439	1,715,505	0.36
Pinewood Finance Co Ltd	3.25%	30/09/25	GBP	1,911	2,374,562	0.49
TI Automotive Finance Plc	3.75%	15/04/29	EUR	1,751	1,778,449	0.37
Vmed O2 UK Financing I Plc	3.25%	31/01/31	EUR	844	860,060	0.18
Vmed O2 UK Financing I Plc	4.50%	15/07/31	GBP	3,634	4,018,736	0.83
					23,419,946	4.86
VEREINIGTE STAATEN						
ATI Inc	7.25%	15/08/30	USD	1,518	1,581,182	0.33
Belden Inc	3.88%	15/03/28	EUR	2,050	2,204,094	0.46
Belden Inc	3.38%	15/07/31	EUR	1,380	1,348,504	0.28

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)						
Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp. / Millennium Op	5.38%	15/04/27	USD	1,296	1,270,170	0.26
Encore Capital Group Inc	5.38%	15/02/26	GBP	1,302	1,588,551	0.33
Ford Motor Credit Co LLC	4.54%	06/03/25	GBP	1,734	2,180,091	0.45
Ford Motor Credit Co LLC	7.12%	07/11/33	USD	2,553	2,752,090	0.57
Global Partners LP / GLP Finance Corp	7.00%	01/08/27	USD	1,508	1,475,759	0.31
KeyBank NA/Cleveland OH	6.95%	01/02/28	USD	1,183	1,205,728	0.25
NuStar Logistics LP	5.75%	01/10/25	USD	2,216	2,204,000	0.46
OneMain Finance Corp	9.00%	15/01/29	USD	2,923	3,092,765	0.64
Schatzanweisung der Vereinigten Staaten	0.38%	31/12/25	USD	9,500	8,805,313	1.82
					29,708,247	6.16
ANLEIHEN INSGESAMT					159,402,604	33.06
OPTIONSSCHEINE						
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Avation Plc			GBP	28	7,156	0.00
					7,156	0.00
OPTIONSSCHEINE INSGESAMT					7,156	0.00
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt					159,409,760	33.06
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
AUSTRALIEN						
FMG Resources August 2006 Pty Ltd 144A	6.13%	15/04/32	USD	1,605	1,618,793	0.33
Mineral Resources Ltd 144A	8.00%	01/11/27	USD	1,473	1,512,221	0.31
Mineral Resources Ltd 144A	9.25%	01/10/28	USD	1,619	1,724,268	0.36
Mineral Resources Ltd 144A	8.50%	01/05/30	USD	1,469	1,533,256	0.32
					6,388,538	1.32
ÖSTERREICH						
Benteler International AG 144A	10.50%	15/05/28	USD	1,454	1,532,843	0.32
KANADA						
Bombardier Inc 144A	7.88%	15/04/27	USD	561	561,629	0.12
Bombardier Inc 144A	6.00%	15/02/28	USD	1,960	1,911,942	0.40
Bombardier Inc 144A	7.50%	01/02/29	USD	1,479	1,504,791	0.31
GFL Environmental Inc 144A	6.75%	15/01/31	USD	2,379	2,454,012	0.51
Intelligent Packaging Ltd Finco, Inc. / Intelligent Packaging Ltd Co.-Issuer LLC 144A	6.00%	15/09/28	USD	3,992	3,728,807	0.77
					10,161,181	2.11
KAIMANINSELN						
Global Aircraft Leasing Co Ltd 144A, PIK	6.50%	15/09/24	USD	1,393	1,310,821	0.27
FRANKREICH						
Altice France SA/France 144A	8.13%	01/02/27	USD	1,153	1,063,810	0.22
Constellium SE 144A	5.63%	15/06/28	USD	1,120	1,094,339	0.23

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
FRANKREICH (Fortsetzung)						
Constellium SE 144A	3.75%	15/04/29	USD	2,677	2,432,832	0.51
Iliad Holding SASU 144A	6.50%	15/10/26	USD	1,607	1,605,005	0.33
Iliad Holding SASU 144A	7.00%	15/10/28	USD	3,072	3,059,141	0.63
					9,255,127	1.92
DEUTSCHLAND						
Commerzbank AG, VRB	7.00%	31/12/49†	USD	2,600	2,509,455	0.52
IRLAND						
LCPR Senior Secured Financing DAC 144A	6.75%	15/10/27	USD	1,568	1,537,369	0.32
LCPR Senior Secured Financing DAC 144A	5.13%	15/07/29	USD	1,147	1,000,592	0.21
					2,537,961	0.53
ITALIEN						
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA, VRB	7.71%	18/01/28	EUR	383	424,165	0.09
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA, VRB	8.50%	10/09/30	EUR	755	840,641	0.17
					1,264,806	0.26
JERSEY						
Adient Global Holdings Ltd 144A	4.88%	15/08/26	USD	1,972	1,929,577	0.40
Adient Global Holdings Ltd 144A	8.25%	15/04/31	USD	1,384	1,466,617	0.30
					3,396,194	0.70
LUXEMBURG						
Aegea Finance Sarl	9.00%	20/01/31	USD	2,128	2,263,341	0.47
Altice Financing SA 144A	5.00%	15/01/28	USD	2,616	2,373,396	0.49
Telecom Italia Capital SA	6.38%	15/11/33	USD	958	938,272	0.20
					5,575,009	1.16
MAURITIUS						
CA Magnum Holdings 144A	5.38%	31/10/26	USD	1,945	1,813,713	0.38
MULTINATIONAL						
Clarios Global LP / Clarios US Finance Co 144A	6.25%	15/05/26	USD	2,207	2,211,244	0.46
NIEDERLANDE						
Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 144A	7.25%	15/02/31	USD	1,679	1,762,922	0.37
SCHWEIZ						
Credit Suisse Group AG, FTB ±#	9.75%	31/12/49†	USD	2,074	248,880	0.05
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
MARB BondCo Plc	3.95%	29/01/31	USD	3,408	2,770,445	0.57
Vodafone Group Plc, VRB	4.13%	04/06/81	USD	2,689	2,318,606	0.48
					5,089,051	1.05
VEREINIGTE STAATEN						
ADT Security Corp 144A	4.13%	01/08/29	USD	1,909	1,758,857	0.36

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)						
Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC 144A						
	7.50%	15/03/26	USD	4,536	4,623,105	0.96
AmeriTex HoldCo Intermediate LLC 144A						
	10.25%	15/10/28	USD	2,758	2,830,398	0.59
Anywhere Real Estate Group LLC / Anywhere Co-Issuer Corp. 144A						
	7.00%	15/04/30	USD	3,340	3,088,465	0.64
Asbury Automotive Group Inc 144A						
	5.00%	15/02/32	USD	1,760	1,601,544	0.33
BCPE Ulysses Intermediate Inc 144A, PIK						
	7.75%	01/04/27	USD	1,678	1,567,292	0.33
Boxer Parent Co Inc 144A						
	7.13%	02/10/25	USD	4,989	5,021,079	1.04
Bread Financial Holdings Inc 144A						
	7.00%	15/01/26	USD	1,645	1,636,495	0.34
Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc 144A						
	6.00%	01/02/26	USD	3,006	3,008,209	0.62
Cablevision Lightpath LLC 144A						
	3.88%	15/09/27	USD	2,499	2,196,947	0.46
Cablevision Lightpath LLC 144A						
	5.63%	15/09/28	USD	1,931	1,523,887	0.32
Camelot Return Merger Sub Inc 144A						
	8.75%	01/08/28	USD	3,985	4,050,052	0.84
Carriage Services Inc 144A						
	4.25%	15/05/29	USD	3,582	3,185,419	0.66
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 144A						
	4.75%	01/03/30	USD	2,814	2,575,373	0.53
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 144A						
	7.38%	01/03/31	USD	3,157	3,242,204	0.67
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 144A						
	4.50%	01/06/33	USD	3,874	3,282,974	0.68
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp 144A						
	5.13%	01/05/27	USD	2,502	2,418,920	0.50
Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp. / Millennium Op 144A						
	5.50%	01/05/25	USD	1,575	1,568,067	0.33
Chart Industries Inc 144A						
	7.50%	01/01/30	USD	1,394	1,458,817	0.30
Chart Industries Inc 144A						
	9.50%	01/01/31	USD	2,365	2,570,757	0.53
Cloud Software Group Inc 144A						
	6.50%	31/03/29	USD	1,659	1,581,443	0.33
Cloud Software Group Inc 144A						
	9.00%	30/09/29	USD	1,713	1,629,599	0.34
CMG Media Corp 144A						
	8.88%	15/12/27	USD	4,117	3,269,166	0.68
Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC 144A						
	6.63%	15/07/30	USD	3,033	3,117,727	0.65
CQP Holdco LP / BIP-V Chinook Holdco LLC 144A						
	5.50%	15/06/31	USD	4,566	4,333,177	0.90
CQP Holdco LP / BIP-V Chinook Holdco LLC 144A						
	7.50%	15/12/33	USD	2,648	2,747,398	0.57
CSC Holdings LLC 144A						
	7.50%	01/04/28	USD	2,150	1,610,447	0.33
CSC Holdings LLC 144A						
	11.25%	15/05/28	USD	2,742	2,827,180	0.59
Dealer Tire LLC / DT Issuer LLC 144A						
	8.00%	01/02/28	USD	4,664	4,622,794	0.96
DISH DBS Corp 144A						
	5.25%	01/12/26	USD	1,603	1,376,376	0.29
DISH DBS Corp 144A						
	5.75%	01/12/28	USD	2,741	2,191,361	0.45
DISH Network Corp 144A						
	11.75%	15/11/27	USD	2,406	2,513,481	0.52
Domtar Corp 144A						
	6.75%	01/10/28	USD	2,623	2,374,180	0.49
Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp 144A						
	5.38%	01/04/26	USD	2,882	2,823,188	0.59
Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp 144A						
	5.88%	01/04/29	USD	3,015	2,851,309	0.59
Forestar Group Inc 144A						
	3.85%	15/05/26	USD	2,740	2,613,109	0.54
Forestar Group Inc 144A						
	5.00%	01/03/28	USD	1,877	1,816,024	0.38
Freedom Mortgage Corp 144A						
	12.00%	01/10/28	USD	1,776	1,941,021	0.40
Gap Inc 144A						
	3.63%	01/10/29	USD	1,845	1,579,735	0.33
Gap Inc 144A						
	3.88%	01/10/31	USD	979	807,630	0.17
Gen Digital Inc 144A						
	6.75%	30/09/27	USD	1,315	1,338,610	0.28
Gen Digital Inc 144A						
	7.13%	30/09/30	USD	1,347	1,409,151	0.29
Global Partners LP / GLP Finance Corp						
	6.88%	15/01/29	USD	1,400	1,357,278	0.28
GPD Cos Inc 144A						
	10.13%	01/04/26	USD	1,256	1,162,428	0.24

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)						
Gray Television Inc 144A	7.00%	15/05/27	USD	3,351	3,188,326	0.66
Griffon Corp	5.75%	01/03/28	USD	3,230	3,177,626	0.66
Hanesbrands Inc 144A	9.00%	15/02/31	USD	4,316	4,233,331	0.88
Herc Holdings Inc 144A	5.50%	15/07/27	USD	2,275	2,248,091	0.47
Iron Mountain Inc 144A	4.88%	15/09/27	USD	1,254	1,224,451	0.25
Iron Mountain Inc 144A	5.25%	15/07/30	USD	1,771	1,687,838	0.35
ITT Holdings LLC 144A	6.50%	01/08/29	USD	5,240	4,640,885	0.96
Jefferies Finance LLC / JFIN Co- Issuer Corp. 144A	5.00%	15/08/28	USD	1,509	1,352,402	0.28
Kaiser Aluminum Corp 144A	4.63%	01/03/28	USD	2,636	2,441,199	0.51
KeyCorp, VRB	3.88%	23/05/25	USD	585	572,045	0.12
Kronos Acquisition Holdings Inc / KIK Custom Products Inc 144A	5.00%	31/12/26	USD	3,070	2,996,059	0.62
Kronos Acquisition Holdings Inc / KIK Custom Products Inc 144A	7.00%	31/12/27	USD	2,036	1,946,599	0.40
LBM Acquisition LLC 144A	6.25%	15/01/29	USD	3,547	3,170,929	0.66
Level 3 Financing Inc 144A	4.63%	15/09/27	USD	1,105	664,022	0.14
Level 3 Financing Inc 144A	10.50%	15/05/30	USD	2,042	1,982,036	0.41
LifePoint Health Inc 144A	9.88%	15/08/30	USD	2,828	2,861,485	0.59
LifePoint Health Inc 144A	11.00%	15/10/30	USD	2,346	2,473,627	0.51
Macy's Retail Holdings LLC 144A	6.13%	15/03/32	USD	2,563	2,428,378	0.50
Matthews International Corp 144A	5.25%	01/12/25	USD	1,549	1,510,525	0.31
McAfee Corp 144A	7.38%	15/02/30	USD	3,326	3,041,915	0.63
Medline Borrower LP 144A	3.88%	01/04/29	USD	2,657	2,405,526	0.50
Nationstar Mortgage Holdings Inc 144A	6.00%	15/01/27	USD	1,599	1,588,654	0.33
Neptune Bidco US Inc 144A	9.29%	15/04/29	USD	3,606	3,365,544	0.70
NESCO Holdings II Inc 144A	5.50%	15/04/29	USD	5,182	4,796,433	0.99
OT Merger Corp 144A	7.88%	15/10/29	USD	1,105	663,082	0.14
Paramount Global, VRB	6.38%	30/03/62	USD	2,802	2,525,162	0.52
Pike Corp 144A	5.50%	01/09/28	USD	2,876	2,743,445	0.57
Post Holdings Inc 144A	5.75%	01/03/27	USD	1,712	1,699,796	0.35
Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc 144A	5.25%	15/04/24	USD	24	23,866	0.01
Primo Water Holdings Inc 144A	4.38%	30/04/29	USD	2,780	2,564,682	0.53
Railworks Holdings LP / Railworks Rally Inc 144A	8.25%	15/11/28	USD	2,089	2,070,523	0.43
Rayonier AM Products Inc 144A	7.63%	15/01/26	USD	3,287	3,020,013	0.63
RegionalCare Hospital Partners Holdings Inc / LifePoint Health Inc 144A	9.75%	01/12/26	USD	1,041	1,033,927	0.21
RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp 144A	7.25%	15/07/28	USD	1,433	1,490,767	0.31
Sealed Air Corp/Sealed Air Corp US 144A	7.25%	15/02/31	USD	2,790	2,961,725	0.61
Sinclair Television Group Inc 144A	4.13%	01/12/30	USD	3,411	2,409,002	0.50
Sirius XM Radio Inc 144A	4.00%	15/07/28	USD	3,924	3,631,595	0.75
Smyrna Ready Mix Concrete LLC 144A	6.00%	01/11/28	USD	4,835	4,767,525	0.99
Smyrna Ready Mix Concrete LLC 144A	8.88%	15/11/31	USD	2,895	3,046,339	0.63
Specialty Building Products Holdings LLC / SBP Finance Corp 144A	6.38%	30/09/26	USD	4,327	4,247,836	0.88
Sprint LLC	7.13%	15/06/24	USD	4,358	4,379,842	0.91
Summer BC Bidco B LLC 144A	5.50%	31/10/26	USD	460	431,298	0.09
Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp 144A	6.00%	31/12/30	USD	2,491	2,319,190	0.48
TEGNA Inc	5.00%	15/09/29	USD	1,672	1,534,110	0.32
Tenet Healthcare Corp	6.25%	01/02/27	USD	1,066	1,071,976	0.22
Tenet Healthcare Corp	6.13%	01/10/28	USD	2,456	2,451,211	0.51
TransDigm Inc 144A	6.25%	15/03/26	USD	3,418	3,415,564	0.71

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)						
Uniti Group LP / Uniti Group Finance Inc / CSL Capital LLC 144A	10.50%	15/02/28	USD	1,674	1,698,541	0.35
Univision Communications Inc 144A	6.63%	01/06/27	USD	1,370	1,367,257	0.28
Univision Communications Inc 144A	7.38%	30/06/30	USD	1,515	1,512,420	0.31
US Foods Inc 144A	6.88%	15/09/28	USD	2,983	3,074,311	0.64
US Foods Inc 144A	7.25%	15/01/32	USD	1,406	1,467,811	0.30
Venture Global LNG Inc 144A	8.13%	01/06/28	USD	1,479	1,494,984	0.31
Viasat Inc 144A	7.50%	30/05/31	USD	1,733	1,362,571	0.28
Victoria's Secret & Co 144A	4.63%	15/07/29	USD	1,939	1,622,112	0.34
Voyager Aviation Holdings LLC 144A *	8.50%	09/05/26	USD	743	609,383	0.13
XPO Inc 144A	7.13%	01/02/32	USD	1,565	1,616,186	0.34
ZF North America Capital Inc 144A	4.75%	29/04/25	USD	2,732	2,702,753	0.56
					240,131,404	49.79
ANLEIHEN INSGESAMT					295,189,149	61.21
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt						
					295,189,149	61.21
Sonstige Wertpapiere						
ANLEIHEN						
AUSTRALIEN						
Quintis Australia Pty Ltd, PIK ^a	7.50%	01/10/26	USD	17	5,018	0.00
Quintis Australia Pty Ltd, PIK ^a	0.00%	01/10/28	USD	162	0	0.00
Quintis Australia Pty Ltd 144A, PIK ^a	7.50%	01/10/26	USD	817	235,351	0.05
					240,369	0.05
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Fagus Holdco Plc	0.00%	05/09/29	EUR	5	4,742	0.00
ANLEIHEN INSGESAMT					245,111	0.05
STAMMAKTIEN						
AUSTRALIEN						
Quintis ^a			USD	79	0	0.00
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Haya Holdco 1 Ltd			GBP	0 ^c	325	0.00
VEREINIGTE STAATEN						
Voyager			USD	2	21	0.00
Voyager			USD	0 ^c	0	0.00
					21	0.00
STAMMAKTIEN INSGESAMT					346	0.00

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Sonstige Wertpapiere (Fortsetzung)						
KURZFRISTIGE SCHATZWECHSEL						
VEREINIGTE STAATEN						
Schatzwechsel der Vereinigten Staaten	0.00%	06/02/24	USD	2,374	2,361,826	0.49
					2,361,826	0.49
KURZFRISTIGE SCHATZWECHSEL INSGESAMT						
					2,607,283	0.54
Sonstige Wertpapiere insgesamt						
					457,206,192	94.81
Anlagen insgesamt <i>(Kosten USD 451,050,376)</i>						
					25,037,421	5.19
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten						
					482,243,613	100.00

Glossar:

FTB - Flat Trading Bond (pauschal gehandelte Anleihe)

FRB - Floating Rate Bond (Anleihe mit variablem Zins)

PIK - Payment-in-Kind (Sachleistung)

S/U - Step Up Bond

VRB - Variable Rate Bond (variabel verzinsliche Anleihe)

± notleidendes Wertpapier

* Die Anzahl der Aktien beträgt weniger als fünfhundert.

† Unbefristete Laufzeit

α Wertpapier zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Die Investition stellt eine zum beizulegenden Zeitwert bewertete Forderung dar

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.

Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Structured Credit Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
DEUTSCHLAND						
Red & Black Auto Germany 10 UG, FRB	5.93%	15/09/32	EUR	1,000	1,003,230	0.37
Red & Black Auto Germany 10 UG, FRB	6.93%	15/09/32	EUR	1,000	1,006,496	0.37
					2,009,726	0.74
IRLAND						
AB Carval Euro CLO I-C DAC, FRB	7.12%	25/01/37	EUR	1,000	1,000,168	0.37
AB Carval Euro CLO I-C DAC, FRB	7.97%	25/01/37	EUR	1,400	1,400,708	0.51
Adagio CLO VIII DAC, FRB	4.90%	15/04/32	EUR	7,500	7,403,234	2.71
Anchorage Capital Europe CLO 6 DAC, FRB	0.00%	22/01/38	EUR	1,000	1,001,339	0.37
Aqueduct European CLO 2-2017 DAC, FRB	5.17%	15/10/30	EUR	2,500	2,491,714	0.91
Avoca CLO XII DAC, FRB	4.76%	15/04/34	EUR	1,700	1,665,262	0.61
Avoca CLO XV DAC, FRB	5.47%	15/04/31	EUR	1,000	961,054	0.35
Avoca CLO XXI DAC, FRB	5.47%	15/04/33	EUR	2,000	1,948,874	0.71
Avoca CLO XXIII DAC, FRB	4.81%	15/04/34	EUR	2,511	2,463,273	0.90
Bain Capital Euro CLO 2022-2 DAC, FRB	8.85%	22/07/36	EUR	1,840	1,842,339	0.67
Bain Capital Euro CLO 2022-2 DAC, FRB	10.26%	22/07/36	EUR	1,070	1,071,534	0.39
Bilbao CLO I DAC, FRB	5.69%	20/07/31	EUR	3,000	2,937,592	1.08
BlackRock European CLO 1 DAC, FRB	5.43%	15/03/31	EUR	1,250	1,202,335	0.44
Blackrock European CLO V DAC, FRB	5.52%	16/07/31	EUR	1,750	1,694,950	0.62
BNPP AM Euro CLO 2018 DAC, FRB	7.02%	15/04/31	EUR	1,300	1,231,389	0.45
Bridgepoint CLO 1 DAC, FRB	5.18%	15/01/34	EUR	5,750	5,711,214	2.09
Bridgepoint CLO 1 DAC, FRB	5.92%	15/01/34	EUR	1,000	987,983	0.36
Bridgepoint CLO 1 DAC, FRB	6.92%	15/01/34	EUR	1,000	1,001,296	0.37
Bridgepoint CLO IV DAC	6.88%	20/01/37	EUR	2,100	2,093,020	0.77
Cairn CLO XVI DAC, FRB	0.00%	15/01/37	EUR	1,000	1,001,275	0.37
Carlyle Euro CLO 2017-2 DAC, FRB	6.07%	15/08/30	EUR	1,000	980,107	0.36
Citizen Irish Auto Receivables Trust 2020 DAC, FRB	6.58%	15/12/29	EUR	1,000	1,007,668	0.37
Citizen Irish Auto Receivables Trust 2020 DAC, FRB	7.33%	15/12/29	EUR	460	460,961	0.17
Citizen Irish Auto Receivables Trust 2023 DAC, FRB	5.25%	15/12/32	EUR	3,500	3,520,125	1.29
Citizen Irish Auto Receivables Trust 2023 DAC, FRB	6.25%	15/12/32	EUR	1,000	1,010,533	0.37
Contego CLO X DAC	6.50%	15/11/36	EUR	2,000	1,946,938	0.71
CVC Cordatus Loan Fund VIII DAC, FRB	5.37%	15/07/34	EUR	1,500	1,437,651	0.53
CVC Cordatus Loan Fund X DAC, FRB	5.14%	27/01/31	EUR	2,000	1,927,203	0.71
CVC Cordatus Loan Fund XIV DAC, FRB	5.46%	22/05/32	EUR	1,500	1,463,792	0.54
Dilosk Rmbs No 4 DAC, FRB	5.35%	20/02/60	EUR	3,402	3,397,008	1.24
Dilosk Rmbs No 5 DAC, FRB	4.86%	20/12/60	EUR	3,000	2,977,556	1.09
Dilosk Rmbs No 6 STS DAC, FRB	6.49%	20/07/61	EUR	1,666	1,670,008	0.61

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Structured Credit Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
IRLAND (Fortsetzung)						
Dilosk Rmbs No 6 STS DAC, FRB	7.99%	20/07/61	EUR	1,062	1,069,089	0.39
Dilosk Rmbs No 7 DAC, FRB	6.76%	20/10/62	EUR	2,224	2,240,088	0.82
Dilosk Rmbs No 7 DAC, FRB	8.36%	20/10/62	EUR	1,480	1,492,266	0.55
Dryden 62 Euro CLO 2017 DAC, FRB	5.67%	15/07/31	EUR	1,500	1,436,689	0.53
Dryden 66 Euro CLO 2018 DAC, FRB	6.43%	18/01/32	EUR	1,500	1,467,398	0.54
Euro-Galaxy VI CLO DAC, FRB	5.48%	11/04/31	EUR	1,500	1,448,734	0.53
Fidelity Grand Harbour CLO 2022-1 Designated Activity Co	6.25%	15/10/36	EUR	1,000	999,833	0.37
Finance Ireland Rmbs No 5 DAC, FRB	5.67%	24/09/62	EUR	2,000	2,017,853	0.74
Finance Ireland Rmbs No 6 DAC, FRB	6.32%	24/09/63	EUR	1,810	1,822,776	0.67
Fortuna Consumer Loan ABS 2021 DAC, FRB	6.04%	18/10/30	EUR	3,000	3,001,458	1.10
Fortuna Consumer Loan ABS 2023-1 DAC, FRB	6.34%	18/09/32	EUR	1,600	1,610,842	0.59
Goldentree Loan Management EUR CLO 6 DAC, FRB	7.64%	20/01/36	EUR	1,450	1,452,927	0.53
Milltown Park CLO DAC, FRB	5.27%	15/01/31	EUR	2,675	2,634,610	0.97
Mulcair Securities No 3 DAC, FRB	5.97%	24/04/65	EUR	3,000	2,956,515	1.08
OZLME III DAC, FRB	5.17%	24/08/30	EUR	2,000	1,939,697	0.71
Palmer Square European CLO 2022-2 DAC, FRB	10.23%	15/01/36	EUR	2,500	2,503,473	0.92
Palmer Square European Loan Funding 2021-2 DAC, FRB	5.57%	15/07/31	EUR	1,656	1,616,296	0.59
Pembroke Property Finance 2 DAC, FRB	5.43%	01/06/40	EUR	2,445	2,438,837	0.89
Pembroke Property Finance 2 DAC, FRB	5.98%	01/06/40	EUR	800	799,835	0.29
Pembroke Property Finance 2 DAC, FRB	6.48%	01/06/40	EUR	2,000	1,970,211	0.72
Primrose Residential 2021-1 DAC, FRB	5.23%	24/03/61	EUR	1,300	1,285,414	0.47
Primrose Residential 2021-1 DAC, FRB	5.78%	24/03/61	EUR	1,400	1,374,150	0.50
Primrose Residential 2021-1 DAC, FRB	6.28%	24/03/61	EUR	1,525	1,459,240	0.53
Primrose Residential 2022-1 DAC, FRB	5.28%	24/10/61	EUR	3,500	3,429,643	1.26
Providus CLO I DAC, FRB	5.59%	14/05/31	EUR	2,500	2,392,894	0.88
Providus CLO III DAC, FRB	6.08%	18/07/34	EUR	846	806,952	0.30
Providus CLO VIII DAC, FRB	10.16%	20/05/37	EUR	1,000	1,005,933	0.37
Signal Harmonic CLO I DAC, FRB	8.17%	15/07/36	EUR	1,000	1,006,252	0.37
Small Business Origination Loan Trust 2021-1 DAC, FRB	7.60%	01/03/30	GBP	1,215	1,400,819	0.51
Sona Fios CLO I DAC, FRB	7.86%	15/07/36	EUR	1,500	1,486,839	0.54
Sutton Park CLO DAC, FRB	5.05%	15/11/31	EUR	3,000	2,879,232	1.05
Tikehau CLO VII DAC, FRB	9.94%	20/10/35	EUR	1,750	1,767,695	0.65
Toro European CLO 4 DAC, FRB	6.07%	15/07/30	EUR	1,280	1,281,661	0.47
Toro European CLO 4 DAC, FRB	7.17%	15/07/30	EUR	3,000	2,957,842	1.08
Toro European CLO 6 DAC, FRB	6.44%	12/01/32	EUR	1,000	968,733	0.35
Trinitas Euro CLO III DAC, FRB	10.26%	25/01/37	EUR	1,320	1,324,501	0.49

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Structured Credit Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
IRLAND (Fortsetzung)						
Trinitas Euro CLO V DAC, FRB	7.60%	25/10/37	EUR	1,500	1,501,449	0.55
					128,158,779	46.94
ITALIEN						
Red & Black Auto Italy Srl, FRB	5.67%	28/07/34	EUR	1,800	1,810,887	0.66
LUXEMBURG						
Pony SA Compartment German Auto Loans 2023-1, FRB	5.06%	14/11/32	EUR	3,200	3,211,415	1.18
Pony SA Compartment German Auto Loans 2023-1, FRB	6.01%	14/11/32	EUR	1,400	1,411,601	0.52
SC Germany SA Compartment Leasing 2023-1, FRB	0.00%	14/12/32	EUR	1,100	1,104,192	0.40
SC Germany SA Compartment Leasing 2023-1, FRB	0.00%	14/12/32	EUR	1,200	1,202,276	0.44
					6,929,484	2.54
NIEDERLANDE						
Domi 2019-1 BV, FRB	6.03%	15/06/51	EUR	500	499,060	0.18
Domi 2021-1 BV, FRB	4.56%	15/06/53	EUR	1,401	1,399,727	0.51
Domi 2021-1 BV, FRB	5.73%	15/06/53	EUR	2,200	2,135,159	0.78
Domi 2023-1 BV, FRB	6.50%	15/02/55	EUR	1,450	1,446,646	0.53
Dryden 32 Euro CLO 2014 BV, FRB	6.25%	15/08/31	EUR	2,250	2,185,957	0.80
Dutch Property Finance 2021-2 BV, FRB	5.00%	28/04/59	EUR	4,105	3,995,378	1.46
Dutch Property Finance 2021-2 BV, FRB	5.35%	28/04/59	EUR	4,500	4,335,980	1.59
Jubilee Place, FRB	5.59%	17/01/59	EUR	500	485,167	0.18
Jubilee Place, FRB	5.99%	17/01/59	EUR	3,150	2,979,120	1.09
Jubilee Place 2020-1 BV, FRB	5.49%	17/10/57	EUR	4,000	3,948,354	1.45
Vecht Residential 2023-1 BV, FRB	4.96%	22/05/58	EUR	7,208	7,207,882	2.64
					30,618,430	11.21
SPANIEN						
Autonoria Spain 2023 FT, FRB	5.88%	30/09/41	EUR	1,400	1,403,667	0.51
Autonoria Spain 2023 FT, FRB	6.78%	30/09/41	EUR	1,000	1,002,000	0.37
FTA Santander Consumer Spain Auto 2023-1, FRB	5.62%	22/09/39	EUR	1,500	1,514,735	0.56
FTA Santander Consumer Spain Auto 2023-1, FRB	6.62%	22/09/39	EUR	2,000	2,022,565	0.74
					5,942,967	2.18
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Barley Hill NO 2 Plc, FRB	6.60%	27/08/58	GBP	1,650	1,890,823	0.69
Cardiff Auto Receivables Securitisation 2022-1 Plc, FRB	7.15%	21/10/28	GBP	3,000	3,466,141	1.27
Dowson 2022-1 Plc, FRB	7.45%	20/01/29	GBP	2,100	2,432,285	0.89
Dowson 2022-1 Plc, FRB	7.90%	20/01/29	GBP	2,033	2,345,032	0.86
Gemgarto 2023-1 Plc, FRB	0.00%	16/12/73	GBP	1,890	2,164,670	0.79

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Structured Credit Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)						
Gemgarto 2023-1 Plc, FRB	0.00%	16/12/73	GBP	5,890	6,790,015	2.49
Mortimer BTL 2021-1 Plc, FRB	6.32%	23/06/53	GBP	900	1,025,513	0.38
Mortimer Btl 2023-1 Plc, FRB	0.00%	22/12/56	GBP	4,118	4,800,498	1.76
PCL Funding VIII Plc, FRB	7.70%	15/05/28	GBP	2,200	2,556,511	0.94
PCL Funding VIII Plc, FRB	8.70%	15/05/28	GBP	1,600	1,865,785	0.68
Polaris 2023-1 Plc, FRB	7.95%	23/02/61	GBP	3,000	3,500,189	1.28
Polaris 2023-1 Plc, FRB	8.85%	23/02/61	GBP	2,800	3,277,689	1.20
Polaris 2023-2 Plc, FRB	8.40%	27/09/59	GBP	2,000	2,336,990	0.86
Together Asset Backed Securitisation 2023-1ST2 Plc, FRB	7.35%	20/04/65	GBP	3,400	3,947,800	1.45
Together Asset Backed Securitisation 2023-1ST2 Plc, FRB	8.35%	20/04/65	GBP	1,050	1,227,190	0.45
Towd Point Mortgage Funding 2019-Auburn 13 Plc, FRB	7.02%	20/07/45	GBP	3,000	3,442,389	1.26
Tower Bridge Funding 2023-2 Plc, FRB	7.42%	20/03/65	GBP	2,300	2,661,887	0.97
Tower Bridge Funding 2023-2 Plc, FRB	8.42%	20/03/65	GBP	2,600	3,015,962	1.10
					52,747,369	19.32
VEREINIGTE STAATEN						
Bellemeade Re 2021-2 Ltd 144A, FRB	6.74%	25/09/31	USD	2,500	2,239,276	0.82
COLT 2023-4 Mortgage Loan Trust 144A, S/U	7.16%	25/10/68	USD	2,730	2,543,007	0.93
Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R01 144A, FRB	7.24%	25/12/41	USD	3,152	2,863,824	1.05
Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R01 144A, FRB	7.74%	25/12/42	USD	1,716	1,585,607	0.58
Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R04 144A, FRB	8.89%	25/05/43	USD	1,549	1,493,396	0.55
Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R08 144A, FRB	7.84%	25/10/43	USD	2,902	2,691,560	0.98
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6 144A, FRB	6.84%	25/10/41	USD	3,000	2,703,311	0.99
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-HQA3 144A, FRB	6.19%	25/09/41	USD	1,712	1,539,182	0.56
Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes 144A, FRB	7.34%	25/06/43	USD	2,734	2,504,503	0.92
Verus Securitization Trust 2023-8 144A, S/U	6.26%	25/12/68	USD	2,900	2,652,564	0.97
Verus Securitization Trust 2023-INV2 144A, S/U	6.44%	25/08/68	USD	1,645	1,507,207	0.55

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Structured Credit Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)						
Verus Securitization Trust 2023- INV3 144A, VRB	6.88%	25/11/68	USD	3,087	2,856,394	1.05
					27,179,831	9.95
ANLEIHEN INSGESAMT					255,397,473	93.54
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt					255,397,473	93.54
Sonstige Wertpapiere						
ANLEIHEN						
VEREINIGTE STAATEN						
Fannie Mae Pool	6.00%	01/11/52	USD	917	845,115	0.31
Freddie Mac Pool	6.00%	01/02/53	USD	2,386	2,197,065	0.80
Freddie Mac Pool	5.50%	01/06/53	USD	2,842	2,586,504	0.95
					5,628,684	2.06
ANLEIHEN INSGESAMT					5,628,684	2.06
Sonstige Wertpapiere insgesamt					5,628,684	2.06
Anlagen insgesamt <i>(Kosten EUR 259,858,783)</i>					261,026,157	95.60
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					12,018,540	4.40
Nettovermögen insgesamt					273,044,697	100.00

Glossar:

FRB - Floating Rate Bond (Anleihe mit variablem Zins)

S/U - Step Up Bond

VRB - Variable Rate Bond (variabel verzinsliche Anleihe)

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.

Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
ANGOLA						
Angolanische internationale Staatsanleihe	9.50%	12/11/25	USD	500	495,625	0.74
ARGENTINIEN						
Pampa Energia SA	7.50%	24/01/27	USD	300	293,062	0.43
Provincia de Cordoba, S/U	6.88%	10/12/25	USD	100	92,502	0.14
					<u>385,564</u>	<u>0.57</u>
KANADA						
MEGlobal Canada ULC	5.00%	18/05/25	USD	1,292	1,279,726	1.90
KAIMANINSELN						
China Evergrande Group [±]	8.25%	23/03/22 ^β	USD	138	2,070	0.00
China Evergrande Group [±]	11.50%	22/01/23 ^β	USD	200	3,000	0.00
DP World Salaam, VRB	6.00%	31/12/49 [†]	USD	665	664,914	0.99
Lamar Funding Ltd	3.96%	07/05/25	USD	1,309	1,279,233	1.90
Meituan	2.13%	28/10/25	USD	200	188,550	0.28
Sands China Ltd	5.38%	08/08/25	USD	738	727,968	1.08
					<u>2,865,735</u>	<u>4.25</u>
KOLUMBIEN						
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	3.88%	22/03/26	EUR	550	601,691	0.89
Ecopetrol SA	5.38%	26/06/26	USD	739	725,606	1.08
					<u>1,327,297</u>	<u>1.97</u>
DOMINIKANISCHE REPUBLIK						
Dominikanische internationale Staatsanleihe	5.50%	27/01/25	USD	778	775,452	1.15
Dominikanische internationale Staatsanleihe	6.88%	29/01/26	USD	886	903,906	1.34
					<u>1,679,358</u>	<u>2.49</u>
ÄGYPTEN						
Ägyptische internationale Staatsanleihe	5.25%	06/10/25	USD	630	578,025	0.86
Ägyptische internationale Staatsanleihe	3.88%	16/02/26	USD	200	164,062	0.24
					<u>742,087</u>	<u>1.10</u>
GEORGIEN						
Georgische internationale Staatsanleihe	2.75%	22/04/26	USD	200	187,844	0.28

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
INDIEN						
Shriram Finance Ltd	4.40%	13/03/24	USD	544	540,165	0.80
IRAK						
Irakische internationale Staatsanleihe	5.80%	15/01/28	USD	591	554,172	0.82
ISRAEL						
Leviathan Bond Ltd 144A	6.13%	30/06/25	USD	132	128,164	0.19
Leviathan Bond Ltd 144A	6.50%	30/06/27	USD	200	188,968	0.28
					317,132	0.47
JORDANIEN						
Jordanische internationale Staatsanleihe	4.95%	07/07/25	USD	300	294,469	0.44
KENIA						
Kenianische internationale Staatsanleihe	6.88%	24/06/24	USD	200	194,969	0.29
LIBANON						
Libanesische internationale Staatsanleihe †	6.38%	09/03/20 ^β	USD	262	16,375	0.02
Libanesische internationale Staatsanleihe †	5.80%	14/04/20 ^β	USD	1	62	0.00
Libanesische internationale Staatsanleihe †	6.15%	19/06/20 ^β	USD	83	5,188	0.01
Libanesische internationale Staatsanleihe †	8.25%	12/04/21 ^β	USD	20	1,244	0.00
					22,869	0.03
LUXEMBURG						
MHP Lux SA	6.95%	03/04/26	USD	200	156,000	0.23
MAURITIUS						
Axian Telecom	7.38%	16/02/27	USD	500	468,516	0.69
Greenko Power II Ltd	4.30%	13/12/28	USD	360	328,050	0.49
HTA Group Ltd/Mauritius	7.00%	18/12/25	USD	335	330,712	0.49
India Green Power Holdings	4.00%	22/02/27	USD	628	576,975	0.86
					1,704,253	2.53
MEXIKO						
BBVA Bancomer SA/Texas	1.88%	18/09/25	USD	425	399,186	0.59
Petroleos Mexicanos	6.88%	16/10/25	USD	701	691,971	1.03
					1,091,157	1.62

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
MULTINATIONAL						
GEMS MENASA Cayman Ltd / GEMS Education Delaware LLC	7.13%	31/07/26	USD	200	196,938	0.29
NIEDERLANDE						
Metinvest BV	8.50%	23/04/26	USD	200	141,000	0.21
Metinvest BV	7.75%	17/10/29	USD	280	170,800	0.25
Royal Capital BV, VRB	5.00%	31/12/49†	USD	200	195,687	0.29
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	6.00%	15/04/24	USD	200	199,750	0.30
					707,237	1.05
NIGERIA						
Nigerianische internationale Staatsanleihe	7.63%	21/11/25	USD	267	264,597	0.39
NORDMAZEDONIEN						
Nordmazedonische internationale Staatsanleihe	6.96%	13/03/27	EUR	420	485,466	0.72
OMAN						
Omanische internationale Staatsanleihe	4.88%	01/02/25	USD	594	590,287	0.88
Omanische internationale Staatsanleihe	4.75%	15/06/26	USD	464	459,360	0.68
					1,049,647	1.56
PAKISTAN						
Pakistanische internationale Staatsanleihe	8.25%	30/09/25	USD	483	412,739	0.61
PANAMA						
Panamaische internationale Staatsanleihe	3.75%	16/03/25	USD	1,650	1,606,430	2.38
PERU						
Fondo MIVIVIENDA SA	4.63%	12/04/27	USD	555	542,271	0.81
PHILIPPINEN						
ROP Sukuk Trust	5.05%	06/06/29	USD	200	203,813	0.30
KATAR						
Katarische internationale Staatsanleihe	3.40%	16/04/25	USD	335	329,210	0.49
RUMÄNIEN						
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.75%	29/10/25	EUR	600	646,489	0.96

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
RUMÄNIEN (Fortsetzung)						
Rumänische internationale Staatsanleihe	5.00%	27/09/26	EUR	244	276,888	0.41
Rumänische internationale Staatsanleihe	6.63%	17/02/28	USD	318	329,190	0.49
					1,252,567	1.86
SERBIEN						
Serbische internationale Anleihe	3.13%	15/05/27	EUR	1,044	1,106,398	1.64
SÜDAFRIKA						
Eskom Holdings SOC Ltd	7.13%	11/02/25	USD	116	116,236	0.17
Südafrikanische internationale Staatsanleihe	5.88%	16/09/25	USD	800	808,250	1.20
					924,486	1.37
SÜDKOREA						
POSCO	5.63%	17/01/26	USD	200	201,766	0.30
SRI LANKA						
Sri-lankische internationale Staatsanleihe, FTB *	6.85%	14/03/24	USD	911	464,041	0.69
Sri-lankische internationale Staatsanleihe, FTB *	6.20%	11/05/27	USD	247	125,275	0.19
					589,316	0.88
ÜBERSTAATLICHE EMITTENTEN						
African Export-Import Bank	2.63%	17/05/26	USD	1,257	1,162,332	1.73
TUNESIEN						
Tunesische Republik	5.63%	17/02/24	EUR	964	1,032,308	1.53
Tunesische Republik	5.75%	30/01/25	USD	200	164,437	0.25
					1,196,745	1.78
TÜRKEI						
Istanbul Metropolitan Municipality	6.38%	09/12/25	USD	323	313,467	0.47
Istanbul Metropolitan Municipality	10.50%	06/12/28	USD	230	244,973	0.36
KOC Holding AS	6.50%	11/03/25	USD	720	718,425	1.07
Mersin Uluslararası Liman Isletmeciliği AS	8.25%	15/11/28	USD	580	607,492	0.90
Türk Telekomunikasyon AS	4.88%	19/06/24	USD	200	197,949	0.29
Turkcell İletişim Hizmetleri AS	5.75%	15/10/25	USD	330	325,667	0.48
Türkische internationale Staatsanleihe	4.25%	14/04/26	USD	231	221,471	0.33
Türkische internationale Staatsanleihe	4.88%	09/10/26	USD	818	789,942	1.17
Türkische internationale Staatsanleihe	5.13%	17/02/28	USD	410	391,550	0.58

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
TÜRKEI (Fortsetzung)						
Türkiye Ihracat Kredi Bankasi AS	9.00%	28/01/27	USD	500	521,953	0.78
Türkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS	6.95%	14/03/26	USD	200	201,250	0.30
Türkiye Vakıflar Bankasi Tao	5.50%	01/10/26	USD	358	343,960	0.51
Ziraat Katilim Varlik Kiralama AS	9.38%	12/11/26	USD	250	263,789	0.39
					5,141,888	7.63
UKRAINE						
Ukrainische internationale Staatsanleihe, FTB †	7.75%	01/09/26	USD	1,177	330,149	0.49
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE						
Abu Dhabi internationale Staatsanleihe	2.13%	30/09/24	USD	1,268	1,237,238	1.84
First Abu Dhabi Bank PJSC	0.13%	16/02/26	EUR	320	326,731	0.48
MDGH GMTN RSC Ltd	2.50%	21/05/26	USD	850	807,020	1.20
					2,370,989	3.52
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Bidvest Group UK Plc	3.63%	23/09/26	USD	700	650,890	0.97
Standard Chartered Plc, VRB	7.78%	16/11/25	USD	200	203,811	0.30
Tullow Oil Plc	10.25%	15/05/26	USD	310	277,111	0.41
Vedanta Resources Finance II Plc	8.95%	11/03/25	USD	247	185,301	0.28
					1,317,113	1.96
VEREINIGTE STAATEN						
DAE Funding LLC	1.55%	01/08/24	USD	200	195,000	0.29
Hikma Finance USA LLC	3.25%	09/07/25	USD	330	316,594	0.47
Kosmos Energy Ltd	7.13%	04/04/26	USD	325	311,136	0.46
Stillwater Mining Co	4.00%	16/11/26	USD	1,167	1,038,630	1.54
Schatzanweisung der Vereinigten Staaten	3.00%	30/06/24	USD	2,500	2,473,888	3.68
					4,335,248	6.44
USBEKISTAN						
Usbekische internationale Staatsanleihe	4.75%	20/02/24	USD	540	538,734	0.80
Usbekische internationale Staatsanleihe	7.85%	12/10/28	USD	200	209,438	0.31
					748,172	1.11
VENEZUELA						
Venezolanische internationale Staatsanleihe †	11.75%	21/10/26	USD	350	65,898	0.10

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
SAMBIA						
Sambische internationale Staatsanleihe, FTB †	5.38%	20/09/22 ^β	USD	630	354,255	0.53
					40,734,092	60.47
ANLEIHEN INSGESAMT						
KURZFRISTIGE ANLEIHEN						
KAIMANINSELN						
Zhenro Properties Group Ltd †	8.00%	06/03/23 ^β	USD	250	3,125	0.01
					3,125	0.01
KURZFRISTIGE ANLEIHEN INSGESAMT						
					40,737,217	60.48
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt						
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
ARGENTINIEN						
YPF SA	8.75%	04/04/24	USD	302	299,560	0.44
YPF SA	8.50%	23/03/25	USD	246	238,098	0.35
YPF SA, S/U	9.00%	12/02/26	USD	104	105,566	0.16
					643,224	0.95
ÖSTERREICH						
Suzano Austria GmbH	5.75%	14/07/26	USD	759	768,369	1.14
BERMUDA						
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd	2.63%	15/08/25	USD	365	343,908	0.51
BRASILIEN						
Cemig Geracao e Transmissao SA	9.25%	05/12/24	USD	122	122,181	0.18
Samarco Mineracao SA, PIK	9.50%	30/06/31	USD	1,620	1,359,180	2.02
					1,481,361	2.20
KANADA						
First Quantum Minerals Ltd	6.88%	01/03/26	USD	215	193,846	0.29
St Marys Cement Inc Canada	5.75%	28/01/27	USD	725	731,684	1.08
					925,530	1.37
KAIMANINSELN						
HPHT Finance 21 II Ltd	1.50%	17/09/26	USD	477	434,642	0.65
Kaisa Group Holdings Ltd, FTB †	11.50%	30/01/23 ^β	USD	250	8,125	0.01
Kaisa Group Holdings Ltd †	11.25%	16/04/25	USD	200	6,500	0.01
Melco Resorts Finance Ltd	4.88%	06/06/25	USD	660	643,397	0.95
MGM China Holdings Ltd	5.38%	15/05/24	USD	200	199,506	0.30
Zhenro Properties Group Ltd †	7.10%	10/09/24	USD	200	2,000	0.00

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
KAIMANINSELN (Fortsetzung)						
Zhenro Properties Group Ltd †	6.70%	04/08/26	USD	200	2,000	0.00
					<u>1,296,170</u>	<u>1.92</u>
CHILE						
Cencosud SA	5.15%	12/02/25	USD	655	648,962	0.96
Cencosud SA	4.38%	17/07/27	USD	328	315,495	0.47
Inversiones CMPC SA	4.75%	15/09/24	USD	1,068	1,061,492	1.58
					<u>2,025,949</u>	<u>3.01</u>
KOLUMBIEN						
Kolumbianische internationale Staatsanleihe	3.88%	25/04/27	USD	435	415,697	0.62
SURA Asset Management SA	4.88%	17/04/24	USD	385	382,538	0.57
					<u>798,235</u>	<u>1.19</u>
EL SALVADOR						
Internationale Staatsanleihe El Salvador	6.38%	18/01/27	USD	230	203,406	0.30
					<u>203,406</u>	<u>0.30</u>
GUATEMALA						
Guatemaltekkische Staatsanleihe	4.50%	03/05/26	USD	343	333,559	0.50
					<u>333,559</u>	<u>0.50</u>
HONGKONG						
Huaxin Cement International Finance Co Ltd	2.25%	19/11/25	USD	665	612,368	0.91
					<u>612,368</u>	<u>0.91</u>
ISRAEL						
Bank Leumi Le-Israel BM 144A	5.13%	27/07/27	USD	627	617,791	0.92
					<u>617,791</u>	<u>0.92</u>
JERSEY						
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd	1.75%	30/09/27	USD	666	627,287	0.93
					<u>627,287</u>	<u>0.93</u>
MEXIKO						
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand	5.38%	17/04/25	USD	768	764,989	1.14
Electricidad Firme de Mexico Holdings SA de CV	4.90%	20/11/26	USD	391	352,068	0.52
Petroleos Mexicanos	4.50%	23/01/26	USD	362	338,713	0.50
Petroleos Mexicanos	3.75%	16/04/26	EUR	191	194,607	0.29
Petroleos Mexicanos	6.49%	23/01/27	USD	368	344,614	0.51
					<u>1,994,991</u>	<u>2.96</u>
NIEDERLANDE						
Greenko Dutch BV	3.85%	29/03/26	USD	305	285,790	0.42
					<u>285,790</u>	<u>0.42</u>

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
NIEDERLANDE (Fortsetzung)						
Suzano International Finance BV	4.00%	14/01/25	USD	300	293,813	0.44
					<u>579,603</u>	<u>0.86</u>
PANAMA						
Banco General SA	4.13%	07/08/27	USD	600	563,250	0.84
PARAGUAY						
Banco Continental SAECA	2.75%	10/12/25	USD	687	643,145	0.96
Paraguayische internationale Staatsanleihe	5.00%	15/04/26	USD	579	574,565	0.85
					<u>1,217,710</u>	<u>1.81</u>
PERU						
Banco de Credito del Peru SA	2.70%	11/01/25	USD	253	245,438	0.36
Compania de Minas Buenaventura SAA	5.50%	23/07/26	USD	400	384,116	0.57
					<u>629,554</u>	<u>0.93</u>
SINGAPUR						
BOC Aviation Ltd	1.75%	21/01/26	USD	900	841,640	1.25
Continuum Energy Aura Pte Ltd	9.50%	24/02/27	USD	350	357,875	0.53
Continuum Energy Levanter Pte Ltd	4.50%	09/02/27	USD	597	565,041	0.84
Medco Maple Tree Pte Ltd	8.96%	27/04/29	USD	330	337,425	0.50
					<u>2,101,981</u>	<u>3.12</u>
SÜDKOREA						
Korea Electric Power Corp	5.38%	31/07/26	USD	900	909,711	1.35
LG Energy Solution Ltd	5.63%	25/09/26	USD	1,147	1,159,531	1.72
					<u>2,069,242</u>	<u>3.07</u>
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Endeavour Mining Plc	5.00%	14/10/26	USD	300	278,156	0.41
VEREINIGTE STAATEN						
DAE Funding LLC	2.63%	20/03/25	USD	1,349	1,297,697	1.93
ANLEIHEN INSGESAMT						
					<u>21,409,341</u>	<u>31.78</u>
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt						
					<u>21,409,341</u>	<u>31.78</u>
Sonstige Wertpapiere						
ANLEIHEN						
BERMUDA						
Digicel Group Holdings Ltd †	0.00%	31/12/30	USD	8	4,603	0.01

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Sonstige Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
BERMUDA (Fortsetzung)						
Digicel Group Holdings Ltd ‡	0.00%	31/12/30	USD	19	1,414	0.00
Digicel Group Holdings Ltd ‡	0.00%	31/12/30	USD	0	83	0.00
Digicel Group Holdings Ltd ‡	0.00%	31/12/30	USD	7	206	0.00
					6,306	0.01
MULTINATIONAL						
Digicel International Finance Ltd/Digicel international Holdings Ltd	8.75%	25/05/24	USD	401	375,771	0.56
					382,077	0.57
ANLEIHEN INSGESAMT						
					382,077	0.57
Sonstige Wertpapiere insgesamt						
					62,528,635	92.83
Anlagen insgesamt (Kosten USD 63,493,067)						
					4,831,926	7.17
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten						
					67,360,561	100.00
Nettovermögen insgesamt						

Glossar:

FTB - Flat Trading Bond (pauschal gehandelte Anleihe)

PIK - Payment-in-Kind (Sachleistung)

S/U - Step Up Bond

VRB - Variable Rate Bond (variabel verzinsliche Anleihe)

± notleidendes Wertpapier

* Die Anzahl der Aktien beträgt weniger als fünfhundert.

† Unbefristete Laufzeit

‡ Die Anlage stellt ein offenstehendes Geschäft nach dem Fälligkeitsdatum dar

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.

Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay High Grade Structured Credit Short Duration Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
BELGIEN						
Bumper BE NV/SA, FRB	4.58%	23/10/31	EUR	4,169	4,176,117	3.07
Bumper BE NV/SA, FRB	4.73%	23/10/31	EUR	2,000	1,991,672	1.46
					6,167,789	4.53
DEUTSCHLAND						
RED & Black Auto Germany 7 UG, FRB	5.03%	15/10/29	EUR	556	556,887	0.41
IRLAND						
Aqueduct European CLO 2-2017 DAC, FRB	5.17%	15/10/30	EUR	4,000	3,986,742	2.93
Avoca CLO XIV DAC, FRB	4.80%	12/01/31	EUR	3,768	3,730,748	2.74
BlueMountain EUR CLO 2016-1 DAC, FRB	4.75%	25/04/32	EUR	1,964	1,945,192	1.43
Bridgepoint CLO 1 DAC, FRB	5.18%	15/01/34	EUR	4,500	4,469,646	3.29
Citizen Irish Auto Receivables Trust 2020 DAC, FRB	4.65%	15/12/29	EUR	2,393	2,395,520	1.76
Citizen Irish Auto Receivables Trust 2023 DAC, FRB	4.62%	15/12/32	EUR	3,768	3,777,359	2.78
Dilosk Rmbs No 5 DAC, FRB	4.64%	20/12/60	EUR	3,412	3,412,559	2.51
Dilosk Rmbs No 7 DAC, FRB	4.96%	20/10/62	EUR	3,952	3,972,197	2.92
Finance Ireland Auto Receivables No 1 DAC, FRB	4.73%	12/09/33	EUR	3,500	3,511,697	2.58
Fortuna Consumer Loan ABS 2021 DAC, FRB	5.34%	18/10/30	EUR	2,296	2,296,973	1.69
Fortuna Consumer Loan ABS 2021 DAC, FRB	6.04%	18/10/30	EUR	2,000	2,000,972	1.47
Fortuna Consumer Loan ABS 2023-1 DAC, FRB	4.64%	18/09/32	EUR	4,000	4,007,532	2.95
Griffith Park CLO DAC, FRB	4.70%	21/11/31	EUR	2,489	2,448,701	1.80
Harvest CLO VII DAC, FRB	4.91%	12/04/31	EUR	132	131,624	0.10
Harvest CLO XIV DAC, FRB	5.45%	18/11/29	EUR	1,429	1,430,234	1.05
Man GLG Euro CLO II DAC, FRB	5.67%	15/01/30	EUR	1,878	1,871,067	1.38
Mulcair Securities No 3 DAC, FRB	4.92%	24/04/65	EUR	2,094	2,092,826	1.54
Northwoods Capital 19 Euro DAC, FRB	4.88%	25/11/33	EUR	2,750	2,704,629	1.99
OCP Euro CLO 2017-2 DAC, FRB	4.79%	15/01/32	EUR	2,703	2,684,994	1.97
Pembroke Property Finance 2 DAC, FRB	5.43%	01/06/40	EUR	2,335	2,328,961	1.71
Primrose Residential 2022-1 DAC, FRB	4.88%	24/10/61	EUR	1,191	1,186,565	0.87
Purple Finance CLO 1 DAC, FRB	4.76%	25/01/31	EUR	342	341,537	0.25
Sculptor European CLO V DAC, FRB	4.76%	14/01/32	EUR	900	887,416	0.65
Signal Harmonic CLO I DAC, FRB	5.77%	15/07/36	EUR	2,000	2,018,947	1.48
Toro European CLO 4 DAC, FRB	4.89%	15/07/30	EUR	165	164,702	0.12
Toro European CLO 4 DAC, FRB	4.89%	15/07/30	EUR	82	82,351	0.06
Toro European CLO 4 DAC, FRB	5.47%	15/07/30	EUR	1,500	1,501,457	1.10
Toro European CLO 4 DAC, FRB	5.47%	15/07/30	EUR	3,600	3,603,498	2.65
Toro European CLO 5 DAC, FRB	4.71%	15/10/30	EUR	1,558	1,543,572	1.13
					66,530,218	48.90
NIEDERLANDE						
Domi 2019-1 BV, FRB	4.78%	15/06/51	EUR	4,407	4,412,208	3.24
Domi 2020-2 BV, FRB	4.88%	15/11/52	EUR	327	328,120	0.24
Domi 2021-1 BV, FRB	4.56%	15/06/53	EUR	747	746,521	0.55
Domi 2023-1 BV, FRB	5.12%	15/02/55	EUR	2,143	2,165,714	1.59
Dutch Property Finance 2019-1 BV, FRB	5.25%	28/10/52	EUR	1,300	1,299,935	0.96

BlueBay Funds – BlueBay High Grade Structured Credit Short Duration Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
NIEDERLANDE (Fortsetzung)						
Dutch Property Finance 2020-1 BV, FRB	4.95%	28/07/54	EUR	2,500	2,489,554	1.83
Dutch Property Finance 2020-1 BV, FRB	4.60%	28/07/54	EUR	1,026	1,026,016	0.76
Dutch Property Finance 2020-2 BV, FRB	5.30%	28/01/58	EUR	4,237	4,231,392	3.11
Dutch Property Finance 2021-1 BV, FRB	4.60%	28/07/58	EUR	3,450	3,447,299	2.53
Dutch Property Finance 2021-2 BV, FRB	4.65%	28/04/59	EUR	1,800	1,800,557	1.32
Dutch Property Finance 2022-2 BV, FRB	4.85%	28/04/62	EUR	1,764	1,770,930	1.30
Jubilee Place, FRB	4.84%	17/01/59	EUR	1,347	1,351,326	0.99
Jubilee Place 2021-1 BV, FRB	4.82%	17/07/58	EUR	2,105	2,109,647	1.55
Vecht Residential 2023-1 BV, FRB	4.96%	22/05/58	EUR	5,286	5,285,780	3.89
					32,464,999	23.86
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Barley Hill NO 2 Plc, FRB	6.12%	27/08/58	GBP	1,641	1,887,757	1.39
Canada Square Funding 6 Plc, FRB	6.07%	17/01/59	GBP	495	571,301	0.42
Dowson 2022-1 Plc, FRB	6.95%	20/01/29	GBP	1,800	2,086,504	1.53
Elstree Funding NO 2 Plc, FRB	5.92%	21/12/54	GBP	3,809	4,384,526	3.23
Eurosail-UK 2007-3bl Plc, FRB	6.29%	13/06/45	GBP	180	206,955	0.15
Mortimer Btl 2023-1 Plc, FRB	0.00%	22/12/56	GBP	3,000	3,476,427	2.55
Polo Funding 2021-1 Plc, FRB	6.20%	26/09/46	GBP	516	595,494	0.44
Dutch Property Finance 2020-1 BV, FRB	4.95%	28/07/54	EUR	2,500	2,489,554	1.83
Dutch Property Finance 2020-1 BV, FRB	4.60%	28/07/54	EUR	1,026	1,026,016	0.76
Dutch Property Finance 2020-2 BV, FRB	5.30%	28/01/58	EUR	4,237	4,231,392	3.11
Dutch Property Finance 2021-1 BV, FRB	4.60%	28/07/58	EUR	3,450	3,447,299	2.53
Residential Mortgage Securities 32 Plc, FRB	6.47%	20/06/70	GBP	1,070	1,237,747	0.91
Stratton Hawksmoor 2022-1 Plc, FRB	6.72%	25/02/53	GBP	2,000	2,312,000	1.70
Stratton Mortgage Funding 2020-1 Plc, FRB	6.82%	12/03/52	GBP	3,000	3,458,389	2.54
Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 Plc, FRB	6.17%	12/07/63	GBP	1,770	2,015,818	1.48
Towd Point Mortgage Funding 2019-Auburn 13 Plc, FRB	7.02%	20/07/45	GBP	1,990	2,283,451	1.68
Trinity Square 2021-1 Plc, FRB	6.07%	15/07/59	GBP	2,262	2,611,185	1.92
					27,127,554	19.94
ANLEIHEN INSGESAMT					132,847,447	97.64
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt					132,847,447	97.64

BlueBay Funds – BlueBay High Grade Structured Credit Short Duration Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Anlagen insgesamt <i>(Kosten EUR 132,037,047)</i>	132,847,447	97.64
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten	3,214,179	2.36
Nettovermögen insgesamt	136,061,626	100.00

Glossar:

FRB - Floating Rate Bond (Anleihe mit variablem Zins)

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.
Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.
Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade ESG Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
AUSTRALIEN						
APA Infrastructure Ltd	1.25%	15/03/33	EUR	167	135,084	0.64
Transurban Finance Co. Pty Ltd	4.23%	26/04/33	EUR	180	189,771	0.91
					324,855	1.55
ÖSTERREICH						
A1 Towers Holding GmbH	5.25%	13/07/28	EUR	100	105,986	0.50
BELGIEN						
FLUVIUS System Operator CVBA	3.88%	09/05/33	EUR	200	207,062	0.99
Proximus SADP	4.13%	17/11/33	EUR	100	106,809	0.51
					313,871	1.50
KANADA						
Magna International Inc	4.38%	17/03/32	EUR	120	128,157	0.61
DÄNEMARK						
Orsted AS	3.63%	01/03/26	EUR	120	120,592	0.58
TDC Net	5.62%	06/02/30	EUR	100	103,154	0.49
Vestas Wind Systems	4.13%	15/06/31	EUR	145	149,775	0.71
					373,521	1.78
FINNLAND						
Nordea Bank Abp, VRB	3.63%	10/02/26	EUR	128	127,697	0.61
Sanoma Oyj	0.63%	18/03/24	EUR	200	198,564	0.95
					326,261	1.56
FRANKREICH						
AXA SA, VRB	4.25%	10/03/43	EUR	100	98,965	0.47
Banque Federative du Credit Mutuel SA	4.38%	02/05/30	EUR	200	208,042	0.99
Banque Federative du Credit Mutuel SA	4.75%	10/11/31	EUR	100	106,239	0.51
Banque Federative du Credit Mutuel SA	3.75%	01/02/33	EUR	100	102,244	0.49
BNP Paribas SA	1.38%	28/05/29	EUR	300	270,252	1.29
BNP Paribas SA, VRB	4.75%	13/11/32	EUR	200	212,410	1.01
BPCE SA	4.50%	13/01/33	EUR	200	210,570	1.00
BPCE SA, VRB	4.75%	14/06/34	EUR	100	106,506	0.51
Clariane SE, VRB	4.13%	31/12/49†	GBP	100	65,437	0.31
Credit Agricole SA	3.88%	20/04/31	EUR	200	206,967	0.99
Credit Agricole SA	4.00%	18/01/33	EUR	200	210,583	1.00
Credit Agricole SA	4.38%	27/11/33	EUR	100	105,119	0.50
Engie SA	4.25%	06/09/34	EUR	100	106,194	0.51
Engie SA	4.50%	06/09/42	EUR	100	107,954	0.51
Indigo Group SAS	4.50%	18/04/30	EUR	200	208,111	0.99
Lagardere SA	1.75%	07/10/27	EUR	100	99,832	0.48
Societe Generale SA, VRB	4.88%	21/11/31	EUR	100	104,701	0.50
Suez SACA	2.88%	24/05/34	EUR	100	93,433	0.45
TDF Infrastructure SASU	2.50%	07/04/26	EUR	100	97,645	0.47
TDF Infrastructure SASU	5.63%	21/07/28	EUR	100	105,161	0.50
Ubisoft Entertainment SA	0.88%	24/11/27	EUR	100	85,097	0.41
					2,911,462	13.89
DEUTSCHLAND						
Allianz SE, VRB	5.82%	25/07/53	EUR	100	109,624	0.52
Bundesobligation	2.20%	13/04/28	EUR	221	223,039	1.06

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade ESG Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
DEUTSCHLAND (Fortsetzung)						
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.50%	15/02/26	EUR	30	28,585	0.14
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.00%	15/08/26	EUR	770	728,940	3.48
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.25%	15/02/27	EUR	730	691,347	3.30
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.50%	15/02/28	EUR	163	153,964	0.73
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.25%	15/02/29	EUR	112	103,363	0.49
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.00%	15/08/29	EUR	11	9,586	0.05
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	2.30%	15/02/33	EUR	190	194,823	0.93
Commerzbank AG, VRB	6.13%	31/12/49†	EUR	200	193,795	0.92
Deutsche Bank AG, VRB	1.75%	19/11/30	EUR	200	174,143	0.83
Deutsche Börse AG	3.88%	28/09/33	EUR	200	213,048	1.02
Eurogrid GmbH	3.72%	27/04/30	EUR	200	204,327	0.98
O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH	1.75%	05/07/25	EUR	100	97,329	0.46
Vonovia SE	5.00%	23/11/30	EUR	100	105,814	0.51
					3,231,727	15.42
IRLAND						
Johnson Controls International Plc	4.25%	23/05/35	EUR	100	106,161	0.51
ITALIEN						
Zi Rete Gas SpA	4.38%	06/06/33	EUR	600	615,421	2.94
ASTM SpA	1.50%	25/01/30	EUR	100	87,177	0.41
ASTM SpA	2.38%	25/11/33	EUR	200	168,351	0.80
Terna – Rete Elettrica Nazionale, VRB	2.38%	31/12/49†	EUR	119	106,839	0.51
					977,788	4.66
JAPAN						
East Japan Railway Co	4.11%	22/02/43	EUR	200	211,935	1.01
JERSEY						
Aptiv Plc	4.35%	15/03/29	USD	222	196,270	0.93
Heathrow Funding Ltd	4.50%	11/07/33	EUR	100	106,549	0.51
					302,819	1.44
LUXEMBURG						
Aroundtown SA	0.38%	15/04/27	EUR	100	80,590	0.38
Eurofins Scientific SE	3.75%	17/07/26	EUR	200	202,537	0.97
Eurofins Scientific SE	4.00%	06/07/29	EUR	200	202,920	0.97
Eurofins Scientific SE, VRB	6.75%	31/12/49†	EUR	279	290,550	1.38
Medtronic Global Holdings SCA	1.63%	15/10/50	EUR	100	68,392	0.33
Prologis International Funding II SA	2.38%	14/11/30	EUR	161	148,291	0.71
Prologis International Funding II SA	1.63%	17/06/32	EUR	125	104,987	0.50
Simon International Finance SCA	1.13%	19/03/33	EUR	149	120,986	0.58
					1,219,253	5.82
NIEDERLANDE						
Abertis Infraestructuras Finance BV, VRB	3.25%	31/12/49†	EUR	100	96,183	0.46
Coöperatieve Rabobank UA, VRB	4.38%	31/12/49†	EUR	400	375,455	1.79

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade ESG Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
NIEDERLANDE (Fortsetzung)						
ELM BV for Firmenich International SA, VRB	3.75%	31/12/49†	EUR	160	157,052	0.75
Iberdrola International BV, VRB	1.87%	31/12/49†	EUR	200	188,668	0.90
Iberdrola International BV, VRB	1.83%	31/12/49†	EUR	100	85,395	0.41
ING Groep NV, VRB	4.75%	23/05/34	EUR	100	106,579	0.51
JAB Holdings BV	5.00%	12/06/33	EUR	100	107,966	0.51
Lseg Netherlands BV	4.23%	29/09/30	EUR	140	147,937	0.71
Prosus NV	1.29%	13/07/29	EUR	100	81,386	0.39
Prosus NV	1.99%	13/07/33	EUR	100	74,133	0.35
Telefonica Europe BV, VRB	2.88%	31/12/49†	EUR	200	182,729	0.87
TenneT Holding BV	4.25%	28/04/32	EUR	100	108,598	0.52
TenneT Holding BV	4.50%	28/10/34	EUR	100	111,629	0.53
Thermo Fisher Scientific Finance I BV	1.63%	18/10/41	EUR	100	75,659	0.36
Thermo Fisher Scientific Finance I BV	2.00%	18/10/51	EUR	100	71,921	0.34
					1,971,290	9.40
PORTUGAL						
Brisa-Concessao Rodoviaria SA	1.88%	30/04/25	EUR	100	97,968	0.47
SPANIEN						
Abertis Infraestructuras SA	4.13%	07/08/29	EUR	100	102,833	0.49
Banco Santander SA	4.88%	18/10/31	EUR	100	106,629	0.51
CaixaBank SA	4.38%	29/11/33	EUR	100	105,218	0.50
CaixaBank SA, VRB	5.13%	19/07/34	EUR	200	213,930	1.02
CaixaBank SA, VRB	5.88%	31/12/49†	EUR	200	194,173	0.93
FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU	5.25%	30/10/29	EUR	229	246,080	1.17
Werfen SA/Spanien	4.63%	06/06/28	EUR	100	102,041	0.49
					1,070,904	5.11
SCHWEIZ						
UBS Group AG, VRB	3.25%	02/04/26	EUR	108	107,073	0.51
UBS Group AG, VRB	7.75%	01/03/29	EUR	192	221,498	1.05
UBS Group AG, VRB	2.88%	02/04/32	EUR	116	108,561	0.52
					437,132	2.08
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Barclays Plc, VRB	5.26%	29/01/34	EUR	104	111,594	0.53
Barclays Plc, VRB	6.38%	31/12/49†	GBP	200	220,257	1.05
DS Smith Plc	4.38%	27/07/27	EUR	128	131,818	0.63
DS Smith Plc	4.50%	27/07/30	EUR	102	106,344	0.51
HSBC Holdings Plc, VRB	4.79%	10/03/32	EUR	100	105,958	0.51
HSBC Holdings Plc, VRB	6.80%	14/09/31	GBP	140	174,511	0.83
HSBC Holdings Plc, VRB	4.86%	23/05/33	EUR	140	148,759	0.71
Inchcape Plc	6.50%	09/06/28	GBP	100	120,238	0.57
ITV Plc	1.38%	26/09/26	EUR	111	104,588	0.50
London Stock Exchange Group Plc	0.88%	19/09/24	EUR	171	167,534	0.80
National Gas Transmission Plc	4.25%	05/04/30	EUR	168	174,611	0.83
NatWest Group Plc, VRB	4.77%	16/02/29	EUR	110	114,480	0.55
NIE Finance Plc	5.88%	01/12/32	GBP	100	124,838	0.60
Northumbrian Water Finance Plc	4.50%	14/02/31	GBP	101	112,493	0.54
Northumbrian Water Finance Plc	6.38%	28/10/34	GBP	100	123,843	0.59
Quadgas Finance Plc	3.38%	17/09/29	GBP	111	113,641	0.54
Swiss Re Finance UK Plc, VRB	2.71%	04/06/52	EUR	100	88,933	0.42
Vodafone Group Plc, VRB	8.00%	30/08/86	GBP	100	123,404	0.59
					2,367,844	11.30

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade ESG Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTE STAATEN						
AT&T Inc	3.95%	30/04/31	EUR	100	103,900	0.50
AT&T Inc	4.30%	18/11/34	EUR	100	105,831	0.50
Carrier Global Corp	4.50%	29/11/32	EUR	100	107,113	0.51
Computershare US Inc	1.13%	07/10/31	EUR	150	117,667	0.56
Euronet Worldwide Inc	1.38%	22/05/26	EUR	191	179,491	0.86
Global Payments Inc	4.88%	17/03/31	EUR	101	106,213	0.51
Thermo Fisher Scientific Inc	1.50%	01/10/39	EUR	125	95,688	0.46
Toyota Motor Credit Corp	4.05%	13/09/29	EUR	286	300,441	1.43
Veralto Corp	4.15%	19/09/31	EUR	101	105,132	0.50
					1,221,476	5.83
ANLEIHEN INSGESAMT					17,700,410	84.44
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt					17,700,410	84.44
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
KAIMANINSELN						
Avolon Holdings Funding Ltd 144A	2.75%	21/02/28	USD	163	131,223	0.63
FRANKREICH						
BNP Paribas SA, VRB	7.75%	31/12/49†	USD	200	185,421	0.89
Societe Generale SA, VRB	9.38%	31/12/49†	USD	200	189,342	0.90
					374,763	1.79
DEUTSCHLAND						
Robert Bosch GmbH	4.00%	02/06/35	EUR	100	106,142	0.51
Robert Bosch GmbH	4.38%	02/06/43	EUR	100	107,560	0.51
					213,702	1.02
ITALIEN						
Intesa Sanpaolo SpA	5.13%	29/08/31	EUR	100	106,834	0.51
Intesa Sanpaolo SpA	5.63%	08/03/33	EUR	150	161,784	0.77
					268,618	1.28
LUXEMBURG						
Bevco Lux Sarl	1.00%	16/01/30	EUR	100	83,825	0.40
NIEDERLANDE						
Sartorius Finance BV	4.38%	14/09/29	EUR	200	207,460	0.99
Sartorius Finance BV	4.50%	14/09/32	EUR	100	104,368	0.50
Sartorius Finance BV	4.88%	14/09/35	EUR	100	105,664	0.50
					417,492	1.99
SPANIEN						
CaixaBank SA 144A, VRB	6.84%	13/09/34	USD	200	191,256	0.91
SCHWEIZ						
Credit Suisse Group AG, FTB ^{*,#}	9.75%	31/12/49†	USD	200	21,726	0.11
VEREINIGTE STAATEN						
Amgen Inc	5.65%	02/03/53	USD	67	63,979	0.30
Amgen Inc	5.75%	02/03/63	USD	90	85,820	0.41

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade ESG Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- Wert EUR	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)						
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications						
Operating Capital	4.40%	01/12/61	USD	129	81,125	0.39
Intel Corp	5.70%	10/02/53	USD	75	73,597	0.35
Warnermedia Holdings Inc	5.05%	15/03/42	USD	362	289,300	1.38
					593,821	2.83
ANLEIHEN INSGESAMT					2,296,426	10.96
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt					2,296,426	10.96
Anlagen insgesamt <i>(Kosten EUR 19,987,548)</i>					19,996,836	95.40
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					964,780	4.60
Nettovermögen insgesamt					20,961,616	100.00

Glossar:

FTB - Flat Trading Bond (pauschal gehandelte Anleihe)

VRB - Variable Rate Bond (variabel verzinsliche Anleihe)

± notleidendes Wertpapier

† Unbefristete Laufzeit

Die Investition stellt eine zum beizulegenden Zeitwert bewertete Forderung dar

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.

Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay Impact – Aligned Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
BELGIEN						
Lonza Finance International NV	3.88%	25/05/33	EUR	1,163	1,335,377	0.81
Proximus SADP	4.13%	17/11/33	EUR	1,000	1,179,868	0.72
					2,515,245	1.53
BRITISCHE JUNGFERINSELN						
Contemporary Ruiding Development Ltd	1.88%	17/09/25	USD	3,045	2,883,465	1.76
KAIMANINSELN						
IHS Holding Ltd	6.25%	29/11/28	USD	230	186,921	0.11
DÄNEMARK						
Orsted A/S, VRB	2.25%	24/11/17 [^]	EUR	1,000	1,080,961	0.66
Orsted AS	4.88%	12/01/32	GBP	937	1,188,001	0.72
Orsted AS, VRB	1.75%	09/12/19 [^]	EUR	1,650	1,602,364	0.98
Vestas Wind Systems	4.13%	15/06/31	EUR	1,677	1,913,505	1.17
					5,784,831	3.53
FINNLAND						
Sanoma Oyj, VRB	8.00%	31/12/49 [†]	EUR	1,540	1,748,784	1.06
Sanoma Oyj	0.63%	18/03/24	EUR	1,300	1,425,733	0.87
					3,174,517	1.93
FRANKREICH						
Banque Federative du Credit Mutuel SA	4.38%	02/05/30	EUR	2,100	2,413,038	1.47
Banque Federative du Credit Mutuel SA	4.75%	10/11/31	EUR	1,100	1,290,925	0.79
Banque Federative du Credit Mutuel SA, VRB	3.88%	16/06/32	EUR	600	655,725	0.40
Clariane SE, VRB	4.13%	31/12/49 [†]	GBP	800	578,283	0.35
Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement	4.50%	06/04/27	EUR	1,780	2,013,377	1.23
Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement	0.63%	16/09/28	EUR	2,355	2,263,987	1.38
La Banque Postale SA, VRB	3.88%	31/12/49 [†]	EUR	2,600	2,579,396	1.57
Suez SACA	5.00%	03/11/32	EUR	1,300	1,590,462	0.97
					13,385,193	8.16
DEUTSCHLAND						
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	7.50%	15/05/30	EUR	1,126	1,327,304	0.81
Deutsche Bahn Finance GmbH	3.63%	18/12/37	EUR	680	785,235	0.48
Infineon Technologies AG	1.63%	24/06/29	EUR	700	717,986	0.43
					2,830,525	1.72
IRLAND						
Johnson Controls International Plc Kerry Group Financial Services Unltd Co	4.25%	23/05/35	EUR	753	883,046	0.54
Smurfit Kappa Treasury ULC	0.88%	01/12/31	EUR	346	324,897	0.20
Trane Technologies Financing Ltd	1.00%	22/09/33	EUR	650	574,883	0.35
	5.25%	03/03/33	USD	2,000	2,074,621	1.26
					3,857,447	2.35

BlueBay Funds – BlueBay Impact – Aligned Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
ITALIEN						
Terna – Rete Elettrica Nazionale, VRB	2.38%	31/12/49†	EUR	1,968	1,951,785	1.19
JAPAN						
East Japan Railway Co	4.11%	22/02/43	EUR	2,349	2,749,665	1.68
Takeda Pharmaceutical Co Ltd	2.00%	09/07/40	EUR	824	724,825	0.44
					3,474,490	2.12
JERSEY						
Aptiv Plc	5.40%	15/03/49	USD	1,456	1,363,588	0.83
Aptiv Plc	3.10%	01/12/51	USD	1,940	1,270,181	0.77
Aptiv Plc / Aptiv Corp.	2.40%	18/02/25	USD	1,220	1,180,240	0.72
					3,814,009	2.32
LUXEMBURG						
Eurofins Scientific SE	4.75%	06/09/30	EUR	1,219	1,420,272	0.87
Eurofins Scientific SE, VRB	6.75%	31/12/49†	EUR	2,732	3,142,835	1.91
					4,563,107	2.78
MAURITIUS						
Clean Renewable Power Mauritius Pte Ltd	4.25%	25/03/27	USD	360	329,513	0.20
MULTINATIONAL						
GEMS MENASA Cayman Ltd / GEMS Education Delaware LLC	7.13%	31/07/26	USD	792	781,743	0.48
NIEDERLANDE						
Cooperatieve Rabobank UA, VRB	4.00%	10/04/29	USD	400	397,163	0.24
Cooperatieve Rabobank UA, VRB	3.10%	31/12/49†	EUR	2,000	1,822,945	1.11
Cooperatieve Rabobank UA, VRB	4.38%	31/12/49†	EUR	800	829,492	0.51
ELM BV for Firmenich International SA, VRB	3.75%	31/12/49†	EUR	2,548	2,762,793	1.68
Iberdrola International BV, VRB	2.25%	31/12/49†	EUR	1,600	1,581,755	0.97
IHS Netherlands Holdco BV	8.00%	18/09/27	USD	200	178,890	0.11
Vestas Wind Systems Finance BV	2.00%	15/06/34	EUR	762	738,850	0.45
Wolters Kluwer NV	3.75%	03/04/31	EUR	475	544,909	0.33
					8,856,797	5.40
SPANIEN						
FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU	5.25%	30/10/29	EUR	334	396,472	0.24
ÜBERSTAATLICHE EMITTENTEN						
Inter-American Development Bank	3.20%	07/08/42	USD	1,000	839,782	0.51
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung	0.00%	31/03/27	USD	250	230,989	0.14
					1,070,771	0.65
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Anchor Hanover Group	2.00%	21/07/51	GBP	801	592,281	0.36
BUPA Finance Plc	5.00%	08/12/26	GBP	532	667,719	0.41
BUPA Finance Plc, VRB	4.00%	31/12/49†	GBP	3,132	2,691,255	1.64
DS Smith Plc	4.50%	27/07/30	EUR	1,869	2,152,516	1.31
London & Quadrant Housing Trust	2.63%	28/02/28	GBP	762	896,525	0.55
London & Quadrant Housing Trust	2.25%	20/07/29	GBP	1,117	1,256,669	0.77

BlueBay Funds – BlueBay Impact – Aligned Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)						
London & Quadrant Housing Trust	2.00%	31/03/32	GBP	682	709,747	0.43
Motability Operations Group Plc	3.50%	17/07/31	EUR	2,893	3,281,321	2.00
Nationwide Building Society, VRB	5.75%	31/12/49†	GBP	1,458	1,718,583	1.05
Nationwide Building Society 144A	3.90%	21/07/25	USD	800	784,837	0.48
NatWest Group Plc, VRB	0.78%	26/02/30	EUR	3,467	3,302,962	2.01
Northumbrian Water Finance Plc	4.50%	14/02/31	GBP	563	692,687	0.42
Northumbrian Water Finance Plc	6.38%	28/10/34	GBP	1,598	2,186,120	1.33
Pearson Funding Plc	3.75%	04/06/30	GBP	1,408	1,677,191	1.02
Renewi Plc	3.00%	23/07/27	EUR	150	162,300	0.10
Severn Trent Utilities Finance Plc	2.63%	22/02/33	GBP	408	437,984	0.27
Severn Trent Utilities Finance Plc	4.63%	30/11/34	GBP	537	670,971	0.41
Severn Trent Utilities Finance Plc	5.25%	04/04/36	GBP	656	865,865	0.53
Severn Trent Utilities Finance Plc	4.88%	24/01/42	GBP	301	373,667	0.23
SSE Plc, VRB	4.00%	31/12/49†	EUR	1,369	1,470,059	0.90
TC Dudgeon Ofco Plc	3.16%	12/11/38	GBP	2,144	2,420,061	1.47
UNITE Group Plc	3.50%	15/10/28	GBP	2,956	3,581,160	2.18
					32,592,480	19.87
VEREINIGTE STAATEN						
Alexandria Real Estate Equities Inc	3.95%	15/01/27	USD	1,450	1,403,770	0.85
Alexandria Real Estate Equities Inc	4.85%	15/04/49	USD	533	475,492	0.29
Alexandria Real Estate Equities Inc	5.15%	15/04/53	USD	1,100	1,065,731	0.65
Carrier Global Corp	4.50%	29/11/32	EUR	1,349	1,596,159	0.97
Ecolab Inc	5.50%	08/12/41	USD	400	420,918	0.26
HCA Inc	5.90%	01/06/53	USD	800	822,639	0.50
Healthcare Realty Holdings LP	3.50%	01/08/26	USD	1,504	1,437,327	0.88
Hikma Finance USA LLC	3.25%	09/07/25	USD	1,300	1,247,385	0.76
KB Home	4.80%	15/11/29	USD	200	192,090	0.12
OneMain Finance Corp	9.00%	15/01/29	USD	1,145	1,212,730	0.74
RELX Capital Inc	3.00%	22/05/30	USD	1,445	1,329,174	0.81
Xylem Inc/NY	3.25%	01/11/26	USD	1,900	1,832,622	1.12
					13,036,037	7.95
ANLEIHEN INSGESAMT					105,485,348	64.29
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt					105,485,348	64.29
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
CHILE						
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	4.70%	07/05/50	USD	400	331,360	0.20
Sociedad de Transmision Austral SA	4.00%	27/01/32	USD	1,353	1,198,736	0.73
					1,530,096	0.93
HONGKONG						
MTR Corp Ltd	1.63%	19/08/30	USD	421	351,277	0.21
INDIEN						
ReNew Pvt Ltd	5.88%	05/03/27	USD	800	766,267	0.47
JAPAN						
East Japan Railway Co	4.39%	05/09/43	EUR	1,166	1,402,073	0.86
LUXEMBURG						
Aegea Finance Sarl	9.00%	20/01/31	USD	1,150	1,223,142	0.75

BlueBay Funds – BlueBay Impact – Aligned Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
LUXEMBURG (Fortsetzung)						
Millicom International Cellular SA	4.50%	27/04/31	USD	400	334,546	0.20
					<hr/>	
					1,557,688	0.95
NIEDERLANDE						
Cooperatieve Rabobank UA	3.75%	21/07/26	USD	2,153	2,065,213	1.26
Sartorius Finance BV	4.50%	14/09/32	EUR	1,200	1,383,483	0.84
Sartorius Finance BV	4.88%	14/09/35	EUR	1,200	1,400,664	0.86
					<hr/>	
					4,849,360	2.96
PARAGUAY						
Telefonica Celular del Paraguay SA	5.88%	15/04/27	USD	500	488,817	0.30
SINGAPUR						
Continuum Energy Aura Pte Ltd	9.50%	24/02/27	USD	2,000	2,041,358	1.24
SÜDKOREA						
LG Energy Solution Ltd	5.63%	25/09/26	USD	1,250	1,264,725	0.77
LG Energy Solution Ltd	5.75%	25/09/28	USD	1,295	1,334,711	0.81
					<hr/>	
					2,599,436	1.58
SPANIEN						
Green Bidco SA	10.25%	15/07/28	EUR	2,085	2,030,509	1.24
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
CSL Finance Plc	4.75%	27/04/52	USD	400	383,526	0.23
VEREINIGTE STAATEN						
Autodesk Inc	4.38%	15/06/25	USD	550	546,318	0.33
Autodesk Inc	2.85%	15/01/30	USD	2,401	2,168,565	1.32
Carrier Global Corp 144A	6.20%	15/03/54	USD	1,000	1,160,624	0.71
CoBank ACB, VRB	4.25%	31/12/49†	USD	500	399,738	0.24
CoBank ACB, VRB	6.45%	31/12/49†	USD	1,767	1,731,196	1.05
Darling Ingredients Inc	6.00%	15/06/30	USD	820	820,580	0.50
Darling Ingredients Inc 144A	6.00%	15/06/30	USD	151	151,107	0.09
George Washington University	4.13%	15/09/48	USD	2,461	2,207,062	1.35
Gilead Sciences Inc	3.65%	01/03/26	USD	300	294,014	0.18
Healthcare Realty Holdings LP	2.40%	15/03/30	USD	1,770	1,458,424	0.89
Humana Inc	5.50%	15/03/53	USD	1,107	1,150,106	0.70
Interface Inc	5.50%	01/12/28	USD	330	307,373	0.19
Johns Hopkins Health System Corp	3.84%	15/05/46	USD	965	822,141	0.50
KB Home	7.25%	15/07/30	USD	646	674,125	0.41
LifePoint Health Inc 144A	11.00%	15/10/30	USD	750	792,314	0.48
OneMain Finance Corp	7.13%	15/03/26	USD	593	604,931	0.37
SLM Corp	4.20%	29/10/25	USD	936	911,068	0.56
Trimble Inc	4.90%	15/06/28	USD	1,472	1,482,606	0.90
Trimble Inc	6.10%	15/03/33	USD	1,337	1,437,168	0.88
Veralto Corp 144A	5.50%	18/09/26	USD	2,400	2,440,453	1.49
Veralto Corp 144A	5.45%	18/09/33	USD	3,101	3,219,489	1.96
					<hr/>	
					24,779,402	15.10
ANLEIHEN INSGESAMT						
					<hr/>	
					42,779,809	26.07
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt						
					<hr/>	
					42,779,809	26.07

BlueBay Funds – BlueBay Impact – Aligned Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Anlagen insgesamt <i>(Kosten USD 142,701,403)</i>	148,265,157	90.36
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten	15,806,353	9.64
Nettovermögen insgesamt	164,071,510	100.00

Glossar:

VRB - Variable Rate Bond (variabel verzinsliche Anleihe)

† Unbefristete Laufzeit

^ Fälligkeitsdatum ist der 24. November 3017

^^ Fälligkeitsdatum ist der 09. Dezember 3019

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.
Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.
Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Government Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
ÖSTERREICH						
Österreichische Staatsanleihe 144A	2.90%	23/05/29	EUR	937	1,067,041	0.45
Österreichische Staatsanleihe 144A	3.15%	20/10/53	EUR	385	445,297	0.19
					1,512,338	0.64
BELGIEN						
Belgische Staatsanleihe 144A	0.00%	22/10/31	EUR	2,151	1,964,987	0.83
Belgische Staatsanleihe 144A	3.00%	22/06/33	EUR	655	747,153	0.32
					2,712,140	1.15
KANADA						
Kanadische Staatsanleihe	1.50%	01/09/24	CAD	4,268	3,170,730	1.34
Kanadische Staatsanleihe	1.00%	01/09/26	CAD	507	360,592	0.15
Kanadische Staatsanleihe	3.25%	01/09/28	CAD	672	511,588	0.22
Kanadische Staatsanleihe	1.25%	01/06/30	CAD	1,203	815,885	0.35
					4,858,795	2.06
CHILE						
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 144A ^Ω	4.70%	01/09/30	CLP	140,000	157,423	0.07
Chilenische internationale Staatsanleihe	4.13%	05/07/34	EUR	1,300	1,470,434	0.62
					1,627,857	0.69
KOLUMBIEN						
Kolumbianische TES	13.25%	09/02/33	COP	1,060,000	326,184	0.14
ESTLAND						
Estnische internationale Staatsanleihe	0.13%	10/06/30	EUR	437	402,121	0.17
Estnische internationale Staatsanleihe	4.00%	12/10/32	EUR	1,530	1,821,903	0.77
					2,224,024	0.94
FRANKREICH						
Französische Staatsanleihe OAT 144A	0.50%	25/05/40	EUR	1,647	1,259,951	0.53
Französische Staatsanleihe OAT 144A	1.50%	25/05/50	EUR	1,164	934,360	0.40
					2,194,311	0.93
DEUTSCHLAND						
Bundesobligation Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	2.20%	13/04/28	EUR	2,958	3,298,912	1.40
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.50%	15/02/26	EUR	6,615	7,041,458	2.98
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.00%	15/02/32	EUR	72	68,483	0.03
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	1.70%	15/08/32	EUR	686	741,651	0.31
					11,150,504	4.72

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Government Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
GRIECHENLAND						
Griechische Staatsanleihe 144A	4.25%	15/06/33	EUR	900	1,090,481	0.46
Griechische Staatsanleihe 144A	4.38%	18/07/38	EUR	2,923	3,550,143	1.51
					4,640,624	1.97
UNGARN						
Ungarische Staatsanleihe	4.75%	24/11/32	HUF	60,900	162,670	0.07
INDONESIEN						
Indonesische Schatzanweisung	7.00%	15/09/30	IDR	30,591,000	2,035,814	0.86
IRLAND						
Irische Staatsanleihe	1.35%	18/03/31	EUR	556	577,246	0.24
ISRAEL						
Israelische Staatsanleihe – Fest ^Ω	0.50%	27/02/26	ILS	1,991	518,733	0.22
Israelische internationale Staatsanleihe	6.50%	06/11/31	USD	1,994	2,150,560	0.91
Israelische internationale Staatsanleihe	0.63%	18/01/32	EUR	3,352	2,865,190	1.21
					5,534,483	2.34
JAPAN						
Japanische zehnjährige Staatsanleihe	0.10%	20/03/27	JPY	1,030,050	7,313,809	3.10
Japanische dreißigjährige Staatsanleihe	1.50%	20/03/45	JPY	601,650	4,307,262	1.82
Japanische dreißigjährige Staatsanleihe	0.80%	20/12/47	JPY	875,200	5,296,371	2.24
Japanische zwanzigjährige Staatsanleihe	0.40%	20/03/36	JPY	792,750	5,350,392	2.27
Japanische zweijährige Staatsanleihe	0.01%	01/07/25	JPY	1,286,400	9,127,137	3.87
					31,394,971	13.30
LETTLAND						
Lettische internationale Staatsanleihe	3.88%	12/07/33	EUR	1,200	1,389,901	0.59
MEXIKO						
Mexikanische Anleihen	5.50%	04/03/27	MXN	230,600	12,186,139	5.16
Mexikanische Anleihen	8.50%	01/03/29	MXN	81,960	4,728,739	2.00
Mexikanische Anleihen	7.75%	29/05/31	MXN	76,510	4,229,347	1.79
Mexikanische internationale Staatsanleihe	6.35%	09/02/35	USD	3,190	3,346,042	1.42
Mexikanische internationale Staatsanleihe	4.00%	15/03/15 [^]	EUR	657	563,024	0.24
					25,053,291	10.61
NEUSEELAND						
Neuseeländische Staatsanleihe	4.25%	15/05/34	NZD	750	470,114	0.20
PERU						
Peruanische Staatsanleihe	6.15%	12/08/32	PEN	616	162,682	0.07

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Government Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
RUMÄNIEN						
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.75%	26/02/26	EUR	758	823,628	0.35
Rumänische internationale Staatsanleihe	6.63%	17/02/28	USD	430	445,712	0.19
Rumänische internationale Staatsanleihe	5.50%	18/09/28	EUR	1,270	1,444,732	0.61
Rumänische internationale Staatsanleihe	6.63%	27/09/29	EUR	1,500	1,774,732	0.75
Rumänische internationale Staatsanleihe	3.62%	26/05/30	EUR	226	229,972	0.10
Rumänische internationale Staatsanleihe	1.75%	13/07/30	EUR	3,965	3,552,186	1.51
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.00%	28/01/32	EUR	258	221,182	0.09
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.00%	14/04/33	EUR	2,626	2,177,623	0.92
Rumänische internationale Staatsanleihe	3.88%	29/10/35	EUR	2,909	2,745,400	1.16
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.75%	14/04/41	EUR	634	471,832	0.20
Rumänische internationale Staatsanleihe	2.88%	13/04/42	EUR	32	24,008	0.01
Rumänische internationale Staatsanleihe	4.63%	03/04/49	EUR	1,062	988,095	0.42
Rumänische internationale Staatsanleihe	3.38%	28/01/50	EUR	919	694,323	0.30
					15,593,425	6.61
SLOWENIEN						
Slowenische internationale Staatsanleihe	5.00%	19/09/33	USD	2,200	2,241,744	0.95
SÜDAFRIKA						
Südafrikanische Staatsanleihe	8.88%	28/02/35	ZAR	56,060	2,587,937	1.10
Südafrikanische Staatsanleihe	8.50%	31/01/37	ZAR	70,999	3,029,563	1.28
					5,617,500	2.38
SPANIEN						
Spanische Staatsanleihe 144A	0.70%	30/04/32	EUR	6,890	6,422,679	2.72
ÜBERSTAATLICHE EMITTENTEN						
Banque Ouest Africaine de Developpement	2.75%	22/01/33	EUR	1,516	1,285,861	0.55
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Staatsanleihe des Vereinigten Königreichs	0.13%	30/01/26	GBP	3,367	3,991,913	1.69
Staatsanleihe des Vereinigten Königreichs	1.25%	22/07/27	GBP	1,296	1,534,120	0.65
Staatsanleihe des Vereinigten Königreichs	4.25%	07/09/39	GBP	868	1,138,634	0.48
Staatsanleihe des Vereinigten Königreichs	1.75%	22/01/49	GBP	3,600	2,903,716	1.23
					9,568,383	4.05
VEREINIGTE STAATEN						
Schatzanweisung der Vereinigten Staaten	0.25%	15/06/24	USD	19,971	19,533,354	8.28
Schatzanweisung der Vereinigten Staaten	1.50%	30/09/24	USD	16,853	16,430,688	6.96

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Government Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)						
Schatzanweisung der Vereinigten Staaten	2.88%	31/05/25	USD	5,098	4,982,797	2.11
					40,946,839	17.35
ANLEIHEN INSGESAMT					179,704,380	76.13
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt					179,704,380	76.13
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
ITALIEN						
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 144A	2.80%	01/03/67	EUR	471	381,051	0.16
POLEN						
Polnische Staatsanleihe	3.25%	25/07/25	PLN	5,249	1,299,838	0.55
THAILAND						
Thailändische Staatsanleihe	3.65%	20/06/31	THB	50,691	1,587,619	0.67
ANLEIHEN INSGESAMT					3,268,508	1.38
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt					3,268,508	1.38
Sonstige Wertpapiere						
KURZFRISTIGE SCHATZWECHSEL						
VEREINIGTE STAATEN						
Schatzwechsel der Vereinigten Staaten	0.00%	16/05/24	USD	17,427	17,092,620	7.24
Schatzwechsel der Vereinigten Staaten	0.00%	06/06/24	USD	15,104	14,763,924	6.26
					31,856,544	13.50
KURZFRISTIGE SCHATZWECHSEL INSGESAMT					31,856,544	13.50
Sonstige Wertpapiere insgesamt					31,856,544	13.50
Anlagen insgesamt (Kosten USD 210,596,859)					214,829,432	91.01
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					21,222,344	8.99
Nettovermögen insgesamt					236,051,776	100.00

Glossar:

Ω Wertpapier mit „Dirty Price“ bewertet

^ Fälligkeitsdatum ist der 15. März 2115

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.
Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.
Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Financials Plus Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere						
ANLEIHEN						
ÖSTERREICH						
Erste Group Bank AG, VRB	4.00%	07/06/33	EUR	900	979,231	2.25
DÄNEMARK						
Danske Bank A/S, VRB	2.50%	21/06/29	EUR	1,030	1,126,061	2.58
FRANKREICH						
AXA SA, VRB	5.50%	11/07/43	EUR	1,030	1,221,187	2.80
BPCE SA, VRB	5.75%	01/06/33	EUR	1,000	1,169,173	2.68
Credit Agricole SA, VRB	7.50%	31/12/49†	GBP	700	887,974	2.04
Credit Mutuel Arkea SA	3.38%	11/03/31	EUR	800	854,305	1.96
					4,132,639	9.48
DEUTSCHLAND						
Commerzbank AG, VRB	5.13%	18/01/30	EUR	700	810,459	1.86
Commerzbank AG, VRB	6.13%	31/12/49†	EUR	200	214,076	0.49
Deutsche Bank AG, VRB	6.13%	12/12/30	GBP	900	1,164,568	2.67
Deutsche Bank AG, VRB	6.75%	31/12/49†	EUR	1,000	1,030,174	2.37
Hannover Rueck SE, VRB	1.75%	08/10/40	EUR	900	858,114	1.97
					4,077,391	9.36
IRLAND						
Bank of Ireland Group Plc, VRB	2.03%	30/09/27	USD	920	840,735	1.93
NIEDERLANDE						
ABN AMRO Bank NV, VRB	5.50%	21/09/33	EUR	900	1,041,629	2.39
Cooperatieve Rabobank UA, VRB	4.38%	31/12/49†	EUR	200	207,373	0.48
ING Groep NV, VRB	6.25%	20/05/33	GBP	1,000	1,285,330	2.95
					2,534,332	5.82
SPANIEN						
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, VRB	5.75%	15/09/33	EUR	100	116,291	0.27
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, VRB	8.25%	30/11/33	GBP	700	961,392	2.20
Banco Santander SA, VRB	5.75%	23/08/33	EUR	1,300	1,507,748	3.46
					2,585,431	5.93
SCHWEDEN						
Skandinaviska Enskilda Banken AB, VRB	6.88%	31/12/49†	USD	800	787,730	1.81
Swedbank AB, VRB	7.27%	15/11/32	GBP	890	1,172,269	2.69
					1,959,999	4.50
SCHWEIZ						
Credit Suisse AG/London	7.75%	10/03/26	GBP	600	805,654	1.85
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Aviva Plc, VRB	6.88%	20/05/58	GBP	630	835,417	1.92
Barclays Plc, VRB	7.09%	06/11/29	GBP	1,200	1,631,108	3.74
Barclays Plc, VRB	8.41%	14/11/32	GBP	330	449,202	1.03
Barclays Plc, VRB	7.13%	31/12/49†	GBP	600	746,309	1.71
BUPA Finance Plc	4.13%	14/06/35	GBP	1,220	1,263,563	2.90
HSBC Holdings Plc, VRB	5.88%	31/12/49†	GBP	820	995,640	2.29
Legal & General Group Plc, VRB	5.63%	31/12/49†	GBP	1,000	1,087,458	2.50
Legal & General Group Plc, VRB	5.25%	21/03/47	USD	1,120	1,080,505	2.48

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Financials Plus Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert (in Tsd.)	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Amtlich notierte Wertpapiere (Fortsetzung)						
ANLEIHEN (Fortsetzung)						
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)						
Lloyds Banking Group Plc, VRB	8.50%	31/12/49†	GBP	400	516,190	1.19
Lloyds Banking Group Plc, VRB	6.63%	02/06/33	GBP	890	1,160,499	2.66
NatWest Group Plc, VRB	5.76%	28/02/34	EUR	1,000	1,164,279	2.67
RL Finance Bonds NO 6 Plc, VRB	10.13%	31/12/49†	GBP	560	761,667	1.75
Standard Chartered Plc, VRB	3.52%	12/02/30	USD	1,080	1,040,255	2.39
					12,732,092	29.23
VEREINIGTE STAATEN						
Goldman Sachs Group Inc	6.75%	01/10/37	USD	770	850,305	1.95
					32,623,870	74.88
ANLEIHEN INSGESAMT						
Amtlich notierte Wertpapiere insgesamt					32,623,870	74.88
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden						
ANLEIHEN						
FRANKREICH						
Societe Generale SA	7.37%	10/01/53	USD	890	939,341	2.16
Societe Generale SA, VRB	9.38%	31/12/49†	USD	660	690,216	1.58
					1,629,557	3.74
IRLAND						
AIB Group Plc, VRB	6.61%	13/09/29	USD	830	874,769	2.01
ITALIEN						
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA, VRB	8.00%	22/01/30	EUR	590	656,281	1.51
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA, VRB	8.50%	10/09/30	EUR	100	111,149	0.26
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	8.25%	21/11/33	USD	830	903,953	2.07
UniCredit SpA, VRB	2.57%	22/09/26	USD	570	536,537	1.23
					2,207,920	5.07
SPANIEN						
CaixaBank SA, VRB	6.84%	13/09/34	USD	830	876,777	2.01
VEREINIGTE STAATEN						
Bank of America Corp, VRB	2.48%	21/09/36	USD	1,050	833,645	1.91
Citigroup Inc, VRB	6.17%	25/05/34	USD	800	829,894	1.91
Morgan Stanley, VRB	5.30%	20/04/37	USD	860	837,633	1.92
					2,501,172	5.74
ANLEIHEN INSGESAMT					8,090,195	18.57
Wertpapiere, die an anderen geregelten Märkten gehandelt werden, insgesamt					8,090,195	18.57

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Financials Plus Bond Fund

Société d'Investissement à Capital Variable

Aufstellung des Wertpapierbestands und der sonstigen Nettovermögenswerte zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

	Markt- wert USD	% des Nettovermögens
Anlagen insgesamt <i>(Kosten USD 36,721,975)</i>	40,714,065	93.45
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten	2,853,844	6.55
Nettovermögen insgesamt	43,567,909	100.00

Glossar:

VRB - Variable Rate Bond (variabel verzinsliche Anleihe)

† Unbefristete Laufzeit

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.
Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, sofern zutreffend, sind in Erläuterung 8 aufgeführt.
Finanzderivate, sofern vorhanden, sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Nettovermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023

	<u>Erläuterung</u>	<u>BlueBay Emerging Market Bond Fund USD</u>	<u>BlueBay High Yield ESG Bond Fund EUR</u>	<u>BlueBay Investment Grade Bond Fund EUR</u>
AKTIVA				
Anlagen zum Marktwert	2	579,111,638	300,123,535	2,093,194,902
Nicht realisierte Wertanstiege aus:				
- Devisenterminkontrakten	2,9	330,807	–	8,647,479
- Finanzterminkontrakten	2,9	–	–	–
- Swap-Vereinbarungen	2,9	–	–	–
Erworbene Optionen zum Marktwert	2,9	25,080	–	–
Barmittel und barmittelähnliche Anlagen	2	34,338,464	11,370,022	138,687,339
Forderungen aus veräußerten Anlagen		3,280,346	–	867,715
Forderungen aus Zeichnungen von Aktien		721,705	1,736,365	7,679,832
Zinsforderungen aus Anlagen	2	10,395,743	4,959,095	37,103,908
Dividendenforderungen	2	–	–	–
Antizipative Aktiva und sonstige Forderungen		2,304	–	76,169
Forderungen für Rückzahlungen von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	–	13,028	–
Summe Aktiva		628,206,087	318,202,045	2,286,257,344
PASSIVA				
Nicht realisierte Wertrückgänge aus:				
- Devisenterminkontrakten	2,9	–	939,977	–
- Finanzterminkontrakten	2,9	210,899	–	11,565,357
- Swap-Vereinbarungen	2,9	899,899	–	16,609,164
Überziehungskredite von Kreditinstituten und Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	2	590,000	131,429	36,712,347
Verbindlichkeiten aus Abonnementsteuer („taxe d'abonnement“)	3	34,347	13,266	115,776
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	6	341,199	217,767	826,851
Verbindlichkeiten aus Performancegebühren	6	–	–	299,146
Verbindlichkeiten aus Administrationsgebühren	5	287,034	313,377	634,362
Verbindlichkeiten aus Depotgebühren	5	58,900	34,673	196,470
Verbindlichkeiten aus Honoraren		29,073	33,145	43,032
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		26,308	1	7,112,142
Verbindlichkeiten aus der Rücknahme von Aktien		2,801,649	453,336	36,047,178
Zinsverbindlichkeiten aus Anlagen	2	36,652	11	300,698
Ausschüttungsverbindlichkeiten	4	–	23,463	52,948
Antizipative Passiva sonstige Verbindlichkeiten		42,923	189,462	119,341
Verbindlichkeiten aus Rückzahlungen von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	54,137	–	37,361
Summe Passiva		5,413,020	2,349,907	110,672,173
GESAMTES NETTOVERMÖGEN		622,793,067	315,852,138	2,175,585,171

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Nettovermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

	<u>Erläuterung</u>	<u>BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund USD</u>	<u>BlueBay Emerging Market Select Bond Fund USD</u>	<u>BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund USD</u>
AKTIVA				
Anlagen zum Marktwert	2	20,477,003	73,153,712	172,370,427
Nicht realisierte Wertanstiege aus:				
- Devisenterminkontrakten	2,9	695,477	2,452,047	1,770,223
- Finanzterminkontrakten	2,9	–	–	–
- Swap-Vereinbarungen	2,9	3,936	–	–
Erworbene Optionen zum Marktwert	2,9	9,765	33,478	7,900
Barmittel und barmittelähnliche Anlagen	2	1,567,462	12,552,257	9,078,176
Forderungen aus veräußerten Anlagen		22,018	666,697	1,658,175
Forderungen aus Zeichnungen von Aktien		693	1,491	–
Zinsforderungen aus Anlagen	2	443,830	1,442,369	2,674,874
Dividendenforderungen	2	–	–	–
Antizipative Aktiva und sonstige Forderungen		–	498	7,341
Forderungen für Rückzahlungen von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	12,644	3,362	–
Summe Aktiva		23,232,828	90,305,911	187,567,116
PASSIVA				
Nicht realisierte Wertrückgänge aus:				
- Devisenterminkontrakten	2,9	–	–	–
- Finanzterminkontrakten	2,9	11,178	245,845	195,028
- Swap-Vereinbarungen	2,9	–	314,179	333,480
Überziehungskredite von Kreditinstituten und Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	2	76,476	3,187,775	–
Verbindlichkeiten aus Abonnementsteuer („taxe d'abonnement“)	3	2,152	–	6,244
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	6	19,832	45,984	170,725
Verbindlichkeiten aus Performancegebühren	6	–	–	392
Verbindlichkeiten aus Administrationsgebühren	5	71,187	74,765	178,087
Verbindlichkeiten aus Depotgebühren	5	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Honoraren		33,924	32,753	33,443
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		1	105,880	10,368
Verbindlichkeiten aus der Rücknahme von Aktien		4,684	1,028	215,614
Zinsverbindlichkeiten aus Anlagen	2	–	7,464	15,816
Ausschüttungsverbindlichkeiten	4	1,472	–	10,989
Antizipative Passiva sonstige Verbindlichkeiten		50,984	30,343	–
Verbindlichkeiten aus Rückzahlungen von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	–	–	12,048
Summe Passiva		271,890	4,046,016	1,182,234
GESAMTES NETTOVERMÖGEN		22,960,938	86,259,895	186,384,882

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Nettovermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

		BlueBay Global Convertible Bond Fund USD	BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund USD	BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund EUR
	<u>Erläuterung</u>			
AKTIVA				
Anlagen zum Marktwert	2	9,873,251	416,059,270	3,523,372,794
Nicht realisierte Wertanstiege aus:				
- Devisenterminkontrakten	2,9	45,732	6,731,994	1,800,891
- Finanzterminkontrakten	2,9	–	–	–
- Swap-Vereinbarungen	2,9	–	25,879,027	–
Erworbene Optionen zum Marktwert	2,9	159,140	10,560	–
Barmittel und barmittelähnliche Anlagen	2	867,517	51,471,206	116,750,682
Forderungen aus veräußerten Anlagen		1	31	–
Forderungen aus Zeichnungen von Aktien		–	74,548	5,716,404
Zinsforderungen aus Anlagen	2	34,652	9,788,504	40,426,989
Dividendenforderungen	2	25,847	–	–
Antizipative Aktiva und sonstige Forderungen		–	75	1,054
Forderungen für Rückzahlungen von				
Aufwendungen über Höchstgrenze	5	–	–	–
Summe Aktiva		11,006,140	510,015,215	3,688,068,814
PASSIVA				
Nicht realisierte Wertrückgänge aus:				
- Devisenterminkontrakten	2,9	–	–	–
- Finanzterminkontrakten	2,9	5,750	–	11,813,717
- Swap-Vereinbarungen	2,9	–	–	1,383,014
Überziehungskredite von Kreditinstituten und				
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	2	–	32,148,761	–
Verbindlichkeiten aus Abonnementsteuer				
(„taxe d'abonnement“)	3	2,029	38,901	301,526
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	6	8,557	285,834	1,029,646
Verbindlichkeiten aus Performancegebühren	6	1,969	–	–
Verbindlichkeiten aus Administrationsgebühren	5	77,923	243,244	493,114
Verbindlichkeiten aus Depotgebühren	5	–	132,953	275,642
Verbindlichkeiten aus Honoraren		27,593	36,380	41,928
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		–	–	–
Verbindlichkeiten aus der Rücknahme von Aktien		–	176,430	7,641,455
Zinsverbindlichkeiten aus Anlagen	2	–	228,509	101,657
Ausschüttungsverbindlichkeiten	4	2,067	139,094	1,025
Antizipative Passiva sonstige Verbindlichkeiten		59,920	20,859	118,048
Verbindlichkeiten aus Rückzahlungen von				
Aufwendungen über Höchstgrenze	5	103,918	22,373	106,046
Summe Passiva		289,726	33,473,338	23,306,818
GESAMTES NETTOVERMÖGEN		10,716,414	476,541,877	3,664,761,996

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Nettovermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

		BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund EUR	BlueBay Global High Yield Bond Fund USD	BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund USD
	<u>Erläuterung</u>	<u>EUR</u>	<u>USD</u>	<u>USD</u>
AKTIVA				
Anlagen zum Marktwert	2	2,239,136,196	1,475,155,399	106,459,006
Nicht realisierte Wertanstiege aus:				
- Devisenterminkontrakten	2,9	5,220,959	5,886,427	2,622,856
- Finanzterminkontrakten	2,9	–	–	–
- Swap-Vereinbarungen	2,9	–	2,107,960	–
Erworbene Optionen zum Marktwert	2,9	–	–	4,640
Barmittel und barmittelähnliche Anlagen	2	154,439,127	62,754,574	5,540,128
Forderungen aus veräußerten Anlagen		217,261	1	–
Forderungen aus Zeichnungen von Aktien		17,329,285	568,169	–
Zinsforderungen aus Anlagen	2	29,495,005	31,152,304	1,395,305
Dividendenforderungen	2	–	–	–
Antizipative Aktiva und sonstige Forderungen		1,076	–	–
Forderungen für Rückzahlungen von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	–	–	–
Summe Aktiva		2,445,838,909	1,577,624,834	116,021,935
PASSIVA				
Nicht realisierte Wertrückgänge aus:				
- Devisenterminkontrakten	2,9	–	–	–
- Finanzterminkontrakten	2,9	19,290,363	–	64,794
- Swap-Vereinbarungen	2,9	12,197,798	–	183,486
Überziehungskredite von Kreditinstituten und Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	2	–	2,260,000	122,733
Verbindlichkeiten aus Abonnementsteuer („taxe d'abonnement“)	3	134,684	106,649	2,364
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	6	892,056	746,585	95,789
Verbindlichkeiten aus Performancegebühren	6	–	41	–
Verbindlichkeiten aus Administrationsgebühren	5	530,989	572,672	72,518
Verbindlichkeiten aus Depotgebühren	5	223,707	142,845	–
Verbindlichkeiten aus Honoraren		44,324	41,680	24,841
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		1,764,561	1,111,625	–
Verbindlichkeiten aus der Rücknahme von Aktien		4,505,837	2,106,223	–
Zinsverbindlichkeiten aus Anlagen	2	287,266	26,637	4,623
Ausschüttungsverbindlichkeiten	4	1,510,000	1,980,806	–
Antizipative Passiva sonstige Verbindlichkeiten		116,595	147,159	34,069
Verbindlichkeiten aus Rückzahlungen von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	37,756	229,541	1,941
Summe Passiva		41,535,936	9,472,463	607,158
GESAMTES NETTOVERMÖGEN		2,404,302,973	1,568,152,371	115,414,777

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Nettovermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

	<u>Erläuterung</u>	<u>BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund EUR</u>	<u>BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund USD</u>	<u>BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund USD</u>
AKTIVA				
Anlagen zum Marktwert	2	746,067,230	71,045,004	2,003,141,654
Nicht realisierte Wertanstiege aus:				
- Devisenterminkontrakten	2,9	4,540,590	1,564,623	–
- Finanzterminkontrakten	2,9	–	49,414	1,702,243
- Swap-Vereinbarungen	2,9	–	–	–
Erworbene Optionen zum Marktwert	2,9	–	3,480	–
Barmittel und barmittelähnliche Anlagen	2	85,681,034	6,384,280	171,690,531
Forderungen aus veräußerten Anlagen		325,226	904,336	3,293,204
Forderungen aus Zeichnungen von Aktien		17,190,915	–	3,347,183
Zinsforderungen aus Anlagen	2	14,458,722	1,239,279	29,845,477
Dividendenforderungen	2	–	–	–
Antizipative Aktiva und sonstige Forderungen		–	10,900	1,224
Forderungen für Rückzahlungen von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	–	1,606	–
Summe Aktiva		868,263,717	81,202,922	2,213,021,516
PASSIVA				
Nicht realisierte Wertrückgänge aus:				
- Devisenterminkontrakten	2,9	–	–	787,667
- Finanzterminkontrakten	2,9	23,171,427	–	–
- Swap-Vereinbarungen	2,9	17,641,861	50,206	10,756,888
Überziehungskredite von Kreditinstituten und Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	2	992,838	–	31,297,081
Verbindlichkeiten aus Abonnementsteuer („taxe d'abonnement“)	3	61,801	2,109	119,989
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	6	430,881	100,308	776,395
Verbindlichkeiten aus Performancegebühren	6	9,150	–	–
Verbindlichkeiten aus Administrationsgebühren	5	465,011	64,682	496,071
Verbindlichkeiten aus Depotgebühren	5	135,038	–	159,798
Verbindlichkeiten aus Honoraren		39,059	26,346	49,673
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		275,353	3,902	3,646,027
Verbindlichkeiten aus der Rücknahme von Aktien		392,025	256,896	386,060
Zinsverbindlichkeiten aus Anlagen	2	495,117	3,427	191,383
Ausschüttungsverbindlichkeiten	4	798,386	–	7,094,495
Antizipative Passiva sonstige Verbindlichkeiten		117,787	30,638	68,744
Verbindlichkeiten aus Rückzahlungen von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	15,167	–	23,455
Summe Passiva		45,040,901	538,514	55,853,726
GESAMTES NETTOVERMÖGEN		823,222,816	80,664,408	2,157,167,790

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Nettovermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

		BlueBay Total Return Credit Fund USD	BlueBay Financial Capital Bond Fund USD	BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund USD
	Erläuterung			
AKTIVA				
Anlagen zum Marktwert	2	499,822,460	1,500,452,205	1,160,266,145
Nicht realisierte Wertanstiege aus:				
- Devisenterminkontrakten	2,9	–	–	40,958,251
- Finanzterminkontrakten	2,9	124,115	–	–
- Swap-Vereinbarungen	2,9	800	–	–
Erworbene Optionen zum Marktwert	2,9	392,298	–	–
Barmittel und barmittelähnliche Anlagen	2	36,179,626	186,281,703	114,079,957
Forderungen aus veräußerten Anlagen		112,539	15,038,068	120,183
Forderungen aus Zeichnungen von Aktien		–	5,778,757	1,424,049
Zinsforderungen aus Anlagen	2	9,177,996	31,338,038	15,004,850
Dividendenforderungen	2	–	–	–
Antizipative Aktiva und sonstige Forderungen		–	–	–
Forderungen für Rückzahlungen von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	–	–	19,668
Summe Aktiva		545,809,834	1,738,888,771	1,331,873,103
PASSIVA				
Nicht realisierte Wertrückgänge aus:				
- Devisenterminkontrakten	2,9	539,325	49,008,492	–
- Finanzterminkontrakten	2,9	–	1,903,243	9,196,231
- Swap-Vereinbarungen	2,9	–	7,002,015	5,941,044
Überziehungskredite von Kreditinstituten und Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	2	683,001	2,701,802	21,851,902
Verbindlichkeiten aus Abonnementsteuer („taxe d'abonnement“)	3	13,551	69,056	52,686
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	6	309,433	1,004,648	372,514
Verbindlichkeiten aus Performancegebühren	6	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Administrationsgebühren	5	171,246	734,482	290,708
Verbindlichkeiten aus Depotgebühren	5	78,467	188,974	137,039
Verbindlichkeiten aus Honoraren		34,759	37,861	37,113
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		798,255	1	176,941,280
Verbindlichkeiten aus der Rücknahme von Aktien		–	1,145,111	99,619
Zinsverbindlichkeiten aus Anlagen	2	27,605	166,638	283,608
Ausschüttungsverbindlichkeiten	4	1,788,411	–	–
Antizipative Passiva sonstige Verbindlichkeiten		44,079	152,997	102,026
Verbindlichkeiten aus Rückzahlungen von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	65,766	198,303	–
Summe Passiva		4,553,898	64,313,623	215,305,770
GESAMTES NETTOVERMÖGEN		541,255,936	1,674,575,148	1,116,567,333

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Nettovermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

	<u>Erläuterung</u>	<u>BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund USD</u>	<u>BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund USD</u>	<u>BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund USD</u>
AKTIVA				
Anlagen zum Marktwert	2	552,349,871	403,618,165	457,206,192
Nicht realisierte Wertanstiege aus:				
- Devisenterminkontrakten	2,9	8,560,379	–	3,395,101
- Finanzterminkontrakten	2,9	331,672	–	–
- Swap-Vereinbarungen	2,9	1,492,066	–	1,652,786
Erworbenene Optionen zum Marktwert	2,9	24,140	340,025	–
Barmittel und barmittelähnliche Anlagen	2	12,594,385	104,533,505	23,675,595
Forderungen aus veräußerten Anlagen		2,862,600	–	2,836
Forderungen aus Zeichnungen von Aktien		13,846	72,968	5,075,851
Zinsforderungen aus Anlagen	2	8,869,447	10,038,536	8,276,563
Dividendenforderungen	2	–	–	–
Antizipative Aktiva und sonstige Forderungen		21	–	11,998
Forderungen für Rückzahlungen von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	–	–	–
Summe Aktiva		587,098,427	518,603,199	499,296,922
PASSIVA				
Nicht realisierte Wertrückgänge aus:				
- Devisenterminkontrakten	2,9	–	560,241	–
- Finanzterminkontrakten	2,9	–	14,609,094	–
- Swap-Vereinbarungen	2,9	–	16,052,477	–
Überziehungskredite von Kreditinstituten und Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	2	1,600,000	–	–
Verbindlichkeiten aus Abonnementsteuer („taxe d'abonnement“)	3	29,052	29,146	21,311
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	6	228,246	381,838	239,086
Verbindlichkeiten aus Performancegebühren	6	–	3,082,964	–
Verbindlichkeiten aus Administrationsgebühren	5	179,519	273,864	242,859
Verbindlichkeiten aus Depotgebühren	5	59,140	78,636	51,118
Verbindlichkeiten aus Honoraren		30,087	44,049	35,087
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		527,800	520,000	12,182,562
Verbindlichkeiten aus der Rücknahme von Aktien		4,843	370,232	2,950,280
Zinsverbindlichkeiten aus Anlagen	2	35,790	549,799	–
Ausschüttungsverbindlichkeiten	4	643,496	2,445	1,269,991
Antizipative Passiva sonstige Verbindlichkeiten		37,812	37,382	33,558
Verbindlichkeiten aus Rückzahlungen von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	63,198	48,077	27,457
Summe Passiva		3,438,983	36,640,244	17,053,309
GESAMTES NETTOVERMÖGEN		583,659,444	481,962,955	482,243,613

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Nettovermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

		BlueBay Investment Grade Structured Credit Fund EUR	BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund USD	BlueBay High Grade Structured Credit Short Duration Fund EUR
	<u>Erläuterung</u>			
AKTIVA				
Anlagen zum Marktwert	2	261,026,157	62,528,635	132,847,447
Nicht realisierte Wertanstiege aus:				
- Devisenterminkontrakten	2,9	–	1,220,851	–
- Finanzterminkontrakten	2,9	–	–	–
- Swap-Vereinbarungen	2,9	–	47,262	–
Erworbene Optionen zum Marktwert	2,9	–	2,320	–
Barmittel und barmittelähnliche Anlagen	2	13,173,837	2,080,489	2,599,296
Forderungen aus veräußerten Anlagen		–	–	–
Forderungen aus Zeichnungen von Aktien		–	742,066	–
Zinsforderungen aus Anlagen	2	1,723,050	908,512	885,885
Dividendenforderungen	2	–	–	–
Antizipative Aktiva und sonstige Forderungen		–	1,112	–
Forderungen für Rückzahlungen von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	9,975	4,942	3,499
Summe Aktiva		275,933,019	67,536,189	136,336,127
PASSIVA				
Nicht realisierte Wertrückgänge aus:				
- Devisenterminkontrakten	2,9	1,591,869	–	182,658
- Finanzterminkontrakten	2,9	–	35,039	–
- Swap-Vereinbarungen	2,9	–	–	–
Überziehungskredite von Kreditinstituten und Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	2	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Abonnementsteuer („taxe d'abonnement“)	3	18,277	4,684	4,359
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	6	54,964	25,175	18,154
Verbindlichkeiten aus Performancegebühren	6	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Administrationsgebühren	5	128,426	32,274	39,307
Verbindlichkeiten aus Depotgebühren	5	21,851	–	–
Verbindlichkeiten aus Honoraren		24,264	24,421	22,783
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		1,000,000	–	–
Verbindlichkeiten aus der Rücknahme von Aktien		19,597	29,981	–
Zinsverbindlichkeiten aus Anlagen	2	–	1,634	–
Ausschüttungsverbindlichkeiten	4	3,456	4,803	–
Antizipative Passiva sonstige Verbindlichkeiten		25,618	17,617	7,240
Verbindlichkeiten aus Rückzahlungen von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	–	–	–
Summe Passiva		2,888,322	175,628	274,501
GESAMTES NETTOVERMÖGEN		273,044,697	67,360,561	136,061,626

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Nettovermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

		BlueBay Investment Grade ESG Bond Fund EUR	BlueBay Impact – Aligned Bond Fund USD	BlueBay Investment Grade Global Government Bond Fund USD
	<u>Erläuterung</u>			
AKTIVA				
Anlagen zum Marktwert	2	19,996,836	148,265,157	214,829,432
Nicht realisierte Wertanstiege aus:				
- Devisenterminkontrakten	2,9	92,893	–	–
- Finanzterminkontrakten	2,9	–	792,430	1,571,779
- Swap-Vereinbarungen	2,9	–	–	599,314
Erworbene Optionen zum Marktwert	2,9	–	–	–
Barmittel und barmittelähnliche Anlagen	2	1,365,069	14,414,075	18,099,397
Forderungen aus veräußerten Anlagen		–	–	2,322,200
Forderungen aus Zeichnungen von Aktien		–	382,975	297,427
Zinsforderungen aus Anlagen	2	341,283	2,327,551	1,783,737
Dividendenforderungen	2	–	–	–
Antizipative Aktiva und sonstige Forderungen		–	2,103	807
Forderungen für Rückzahlungen von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	10,801	4,209	18,178
Summe Aktiva		21,806,882	166,188,500	239,522,271
PASSIVA				
Nicht realisierte Wertrückgänge aus:				
- Devisenterminkontrakten	2,9	–	1,823,854	2,037,916
- Finanzterminkontrakten	2,9	112,039	–	–
- Swap-Vereinbarungen	2,9	174,333	–	–
Überziehungskredite von Kreditinstituten und Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	2	505,306	–	644,513
Verbindlichkeiten aus Abonnementsteuer („taxe d'abonnement“)	3	1,666	10,742	15,971
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	6	7,837	39,238	64,390
Verbindlichkeiten aus Performancegebühren	6	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Administrationsgebühren	5	7,076	39,024	68,016
Verbindlichkeiten aus Depotgebühren	5	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Honoraren		21,580	22,021	26,029
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		10,351	–	280,000
Verbindlichkeiten aus der Rücknahme von Aktien		–	85,533	277,290
Zinsverbindlichkeiten aus Anlagen	2	3,158	–	27,516
Ausschüttungsverbindlichkeiten	4	–	96,578	29
Antizipative Passiva sonstige Verbindlichkeiten		1,920	–	28,825
Verbindlichkeiten aus Rückzahlungen von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	–	–	–
Summe Passiva		845,266	2,116,990	3,470,495
GESAMTES NETTOVERMÖGEN		20,961,616	164,071,510	236,051,776

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Nettovermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

AKTIVA	Erläuterung	BlueBay Investment	Konsolidiert
		Grade Financials Plus Bond Fund USD	EUR
Anlagen zum Marktwert	2	40,714,065	18,338,440,944
Nicht realisierte Wertanstiege aus:			
- Devisenterminkontrakten	2,9	–	89,315,413
- Finanzterminkontrakten	2,9	–	4,138,554
- Swap-Vereinbarungen	2,9	–	28,772,146
Erworbene Optionen zum Marktwert	2,9	–	916,875
Barmittel und barmittelähnliche Anlagen	2	3,700,271	1,313,351,351
Forderungen aus veräußerten Anlagen		–	28,824,528
Forderungen aus Zeichnungen von Aktien		–	66,401,752
Zinsforderungen aus Anlagen	2	770,973	289,542,892
Dividendenforderungen	2	–	23,398
Antizipative Aktiva und sonstige Forderungen		–	113,046
Forderungen für Rückzahlungen von			
Aufwendungen über Höchstgrenze	5	111,815	197,013
Summe Aktiva		45,297,124	20,160,037,912
PASSIVA			
Nicht realisierte Wertrückgänge aus:			
- Devisenterminkontrakten	2,9	1,486,481	53,630,158
- Finanzterminkontrakten	2,9	48,226	89,965,330
- Swap-Vereinbarungen	2,9	–	85,605,115
Überziehungskredite von Kreditinstituten und			
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	2	–	126,301,043
Verbindlichkeiten aus Abonnementsteuer („taxe			
d'abonnement“)	3	1,043	1,160,137
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	6	19,914	8,254,049
Verbindlichkeiten aus Performancegebühren	6	–	3,101,367
Verbindlichkeiten aus Administrationsgebühren	5	6,055	6,392,253
Verbindlichkeiten aus Depotgebühren	5	–	1,872,191
Verbindlichkeiten aus Honoraren		42,150	875,993
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen		–	187,733,596
Verbindlichkeiten aus der Rücknahme von Aktien		–	58,937,193
Zinsverbindlichkeiten aus Anlagen	2	–	2,642,758
Ausschüttungsverbindlichkeiten	4	899	14,189,916
Antizipative Passiva sonstige Verbindlichkeiten		124,447	1,659,558
Verbindlichkeiten aus Rückzahlungen von			
Aufwendungen über Höchstgrenze	5	–	965,998
Summe Passiva		1,729,215	643,286,655
GESAMTES NETTOVERMÖGEN		43,567,909	19,516,751,257

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens zum 31. Dezember 2023

	Erläuterung	BlueBay Emerging Market Bond Fund USD	BlueBay High Yield ESG Bond Fund EUR	BlueBay Investment Grade Bond Fund EUR
ERTRÄGE				
Dividende (nach Abzug der Quellensteuer)	2	–	–	–
Zinserträge aus Anlagen (abzüglich Quellensteuer)	2	13,910,519	8,897,673	41,222,675
Zinserträge aus Swap-Vereinbarungen		25,990	–	431,938
Bankzinsen		746,021	155,520	2,351,070
Sonstige Erträge		1,281	234	1,621
Summe Erträge		14,683,811	9,053,427	44,007,304
AUFWENDUNGEN				
Verwaltungsgebühren	6	1,714,590	1,233,914	4,630,566
Performancegebühren	6	–	–	178,991
Abonnementsteuer („taxe d'abonnement“)	3	70,583	62,337	322,576
Honorar der Geschäftsführung	7	3,649	3,304	3,304
Administrationsgebühren	5	144,408	138,941	338,291
Depotgebühren	5	29,633	15,373	104,773
Honorare		12,316	13,009	26,058
Transaktionskosten	2	3,286	952	81,140
Zinsaufwendungen aus Anlagen	2	–	–	–
Zinsaufwendungen aus Swap-Vereinbarungen		557,244	–	4,632,955
Bankzinsen		–	–	–
Sonstige Aufwendungen		74,863	26,632	569,459
Summe Aufwendungen		2,610,572	1,494,462	10,888,113
Aufwendung (Zahlung)/Rückerstattung von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	(141,624)	42,431	(132,022)
NETTOERTRÄGE AUS ANLAGEN		11,931,615	7,601,396	32,987,169
Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) aus:				
- Anlagen	2	(8,423,715)	(2,164,781)	(29,486,977)
- Devisenterminkontrakten	2	3,284,393	(372,574)	(11,292,231)
- Finanzterminkontrakten	2	211,011	(417,284)	7,772,561
- Swap-Vereinbarungen	2	318,029	–	(8,057,182)
- Optionen	2	39,508	–	–
- Devisengeschäften		(86,583)	47,304	1,970,066
NETTOANLAGEERTRÄGE UND REALISIERTE WERTANSTIEGE/(-RÜCKGÄNGE)		7,274,258	4,694,061	(6,106,594)

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

		BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund USD	BlueBay Emerging Market Select Bond Fund USD	BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund USD
ERTRÄGE	Erläuterung			
Dividende (nach Abzug der Quellensteuer)	2	–	–	–
Zinserträge aus Anlagen (abzüglich Quellensteuer)	2	729,339	2,693,080	6,270,974
Zinserträge aus Swap-Vereinbarungen		7,115	1,480,037	6,396
Bankzinsen		51,459	82,955	156,669
Sonstige Erträge		7,330	327	46,297
Summe Erträge		795,243	4,256,399	6,480,336
AUFWENDUNGEN				
Verwaltungsgebühren	6	115,627	257,381	1,009,271
Performancegebühren	6	–	–	–
Abonnementsteuer („taxe d'abonnement“)	3	5,039	6,988	22,124
Honorar der Geschäftsführung	7	3,649	3,649	3,649
Administrationsgebühren	5	5,345	18,190	36,651
Depotgebühren	5	–	–	–
Honorare		11,153	11,076	11,891
Transaktionskosten	2	524	267	1,455
Zinsaufwendungen aus Anlagen	2	–	–	–
Zinsaufwendungen aus Swap-Vereinbarungen		8,060	1,532,667	216,287
Bankzinsen		32	–	1
Sonstige Aufwendungen		34,316	29,508	41,961
Summe Aufwendungen		183,745	1,859,726	1,343,290
Aufwendung (Zahlung)/Rückerstattung von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	36,862	4,862	(48,687)
NETTOERTRÄGE AUS ANLAGEN		648,360	2,401,535	5,088,359
Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) aus:				
- Anlagen	2	(175,058)	(249,271)	(7,141,544)
- Devisenterminkontrakten	2	(254,648)	(2,349,909)	(1,566,893)
- Finanzterminkontrakten	2	9,393	195,375	(119,801)
- Swap-Vereinbarungen	2	348	145,024	188,636
- Optionen	2	17,163	67,102	20,866
- Devisengeschäften		13,887	209,661	(14,987)
NETTOANLAGEERTRÄGE UND REALISIERTE WERTANSTIEGE/(-RÜCKGÄNGE)		259,445	419,517	(3,545,364)

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

		BlueBay Global Convertible Bond Fund USD	BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund USD	BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund EUR
	<u>Erläuterung</u>			
ERTRÄGE				
Dividende (nach Abzug der Quellensteuer)	2	4,465	–	–
Zinserträge aus Anlagen (abzüglich Quellensteuer)	2	60,225	27,427,678	39,119,850
Zinserträge aus Swap-Vereinbarungen		–	8,176,333	146,281
Bankzinsen		53,985	365,655	1,528,439
Sonstige Erträge		2,658	3,709	157
Summe Erträge		121,333	35,973,375	40,794,727
AUFWENDUNGEN				
Verwaltungsgebühren	6	115,029	1,773,944	5,569,299
Performancegebühren	6	–	–	–
Abonnementsteuer („taxe d'abonnement“)	3	5,274	85,536	566,397
Honorar der Geschäftsführung	7	3,649	3,649	3,304
Administrationsgebühren	5	6,801	109,933	318,286
Depotgebühren	5	–	60,087	177,916
Honorare		9,226	14,814	32,247
Transaktionskosten	2	4,447	5,368	131,536
Zinsaufwendungen aus Anlagen	2	–	–	–
Zinsaufwendungen aus Swap-Vereinbarungen		–	11,315,862	260,503
Bankzinsen		–	2,145	–
Sonstige Aufwendungen		65,955	146,956	203,065
Summe Aufwendungen		210,381	13,518,294	7,262,553
Aufwendung (Zahlung)/Rückerstattung von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	28,583	(106,629)	(275,388)
NETTOERTRÄGE AUS ANLAGEN		(60,465)	22,348,452	33,256,786
Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) aus:				
- Anlagen	2	1,462,473	(12,081,690)	(2,460,228)
- Devisenterminkontrakten	2	5,695	(17,406,550)	(12,410,805)
- Finanzterminkontrakten	2	(28,222)	473,871	3,446,731
- Swap-Vereinbarungen	2	–	(4,447,897)	11,858,260
- Optionen	2	(246,328)	96,517	–
- Devisengeschäften		(36,398)	1,523,735	1,623,740
NETTOANLAGEERTRÄGE UND REALISIERTE WERTANSTIEGE/(-RÜCKGÄNGE)		1,096,755	(9,493,562)	35,314,484

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

		BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund EUR	BlueBay Global High Yield Bond Fund USD	BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund USD
	<u>Erläuterung</u>			
ERTRÄGE				
Dividende (nach Abzug der Quellensteuer)	2	–	–	–
Zinserträge aus Anlagen (abzüglich Quellensteuer)	2	32,071,633	56,228,295	2,528,947
Zinserträge aus Swap-Vereinbarungen		221,127	794,287	2,450
Bankzinsen		1,621,755	1,476,922	92,282
Sonstige Erträge		5,793	105,824	21,614
Summe Erträge		33,920,308	58,605,328	2,645,293
AUFWENDUNGEN				
Verwaltungsgebühren	6	5,081,471	4,591,513	550,089
Performancegebühren	6	–	–	–
Abonnementsteuer („taxe d'abonnement“)	3	279,564	231,419	5,017
Honorar der Geschäftsführung	7	3,304	3,649	3,649
Administrationsgebühren	5	269,191	222,635	26,125
Depotgebühren	5	113,411	55,533	–
Honorare		27,257	22,365	8,663
Transaktionskosten	2	139,463	5,026	647
Zinsaufwendungen aus Anlagen	2	–	–	–
Zinsaufwendungen aus Swap-Vereinbarungen		2,974,353	–	61,257
Bankzinsen		–	–	–
Sonstige Aufwendungen		244,704	127,351	29,966
Summe Aufwendungen		9,132,718	5,259,491	685,413
Aufwendung (Zahlung)/Rückerstattung von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	(131,015)	(751,444)	(14,707)
NETTOERTRÄGE AUS ANLAGEN		24,656,575	52,594,393	1,945,173
Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) aus:				
- Anlagen	2	(43,647,527)	(24,681,187)	(2,507,859)
- Devisenterminkontrakten	2	(23,283,081)	1,578,794	(1,900,584)
- Finanzterminkontrakten	2	3,767,323	(4,675,721)	(65,692)
- Swap-Vereinbarungen	2	5,103,201	–	177,806
- Optionen	2	–	–	13,937
- Devisengeschäften		3,360,685	250,373	(31,059)
NETTOANLAGEERTRÄGE UND REALISIERTE WERTANSTIEGE/(-RÜCKGÄNGE)		(30,042,824)	25,066,652	(2,368,278)

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

		BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund EUR	BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund USD	BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund USD
	<u>Erläuterung</u>			
ERTRÄGE				
Dividende (nach Abzug der Quellensteuer)	2	–	–	–
Zinserträge aus Anlagen (abzüglich Quellensteuer)	2	19,126,394	3,470,142	46,006,164
Zinserträge aus Swap-Vereinbarungen		1,724,432	910	291,057
Bankzinsen		1,465,040	91,920	3,181,835
Sonstige Erträge		858	39,883	199,849
Summe Erträge		22,316,724	3,602,855	49,678,905
AUFWENDUNGEN				
Verwaltungsgebühren	6	2,704,923	614,494	3,981,846
Performancegebühren	6	2,157	–	–
Abonnementsteuer („taxe d'abonnement“)	3	117,670	4,222	246,624
Honorar der Geschäftsführung	7	3,304	3,649	3,649
Administrationsgebühren	5	207,925	19,464	236,375
Depotgebühren	5	60,381	–	76,143
Honorare		16,689	8,771	25,872
Transaktionskosten	2	51,629	230	93,972
Zinsaufwendungen aus Anlagen	2	–	–	–
Zinsaufwendungen aus Swap-Vereinbarungen		6,424,989	55,252	3,137,421
Bankzinsen		176	20	70
Sonstige Aufwendungen		96,073	28,603	236,658
Summe Aufwendungen		9,685,916	734,705	8,038,630
Aufwendung (Zahlung)/Rückerstattung von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	(54,305)	(3,444)	(84,849)
NETTOERTRÄGE AUS ANLAGEN		12,576,503	2,864,706	41,555,426
Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) aus:				
- Anlagen	2	(26,644,171)	(3,344,561)	(25,790,668)
- Devisenterminkontrakten	2	(21,266,542)	(1,300,750)	9,082,515
- Finanzterminkontrakten	2	14,158,934	(30,945)	(2,175,879)
- Swap-Vereinbarungen	2	(1,945,065)	(40,970)	(4,822,222)
- Optionen	2	–	8,657	–
- Devisengeschäften		1,282,369	(18,877)	(774,627)
NETTOANLAGEERTRÄGE UND REALISIERTE WERTANSTIEGE/(-RÜCKGÄNGE)		(21,837,972)	(1,862,740)	17,074,545

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

		BlueBay Total Return Credit Fund	BlueBay Financial Capital Bond Fund	BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund
	<u>Erläuterung</u>	<u>USD</u>	<u>USD</u>	<u>USD</u>
ERTRÄGE				
Dividende (nach Abzug der Quellensteuer)	2	–	–	–
Zinserträge aus Anlagen (abzüglich Quellensteuer)	2	17,715,599	58,750,902	16,899,558
Zinserträge aus Swap-Vereinbarungen		152,937	200,754	3,336,568
Bankzinsen		767,890	1,787,096	848,332
Sonstige Erträge		1,135	740	894
Summe Erträge		18,637,561	60,739,492	21,085,352
AUFWENDUNGEN				
Verwaltungsgebühren	6	1,836,059	5,902,795	1,897,628
Performancegebühren	6	–	–	–
Abonnementsteuer („taxe d'abonnement“)	3	31,384	154,422	103,456
Honorar der Geschäftsführung	7	3,649	3,649	3,649
Administrationsgebühren	5	73,109	320,092	118,376
Depotgebühren	5	33,499	82,356	55,802
Honorare		20,770	20,062	16,690
Transaktionskosten	2	29,024	8,322	53,989
Zinsaufwendungen aus Anlagen	2	43	–	22
Zinsaufwendungen aus Swap-Vereinbarungen		567,048	6,740,056	5,360,998
Bankzinsen		–	367	13,134
Sonstige Aufwendungen		71,160	175,428	305,654
Summe Aufwendungen		2,665,745	13,407,549	7,929,398
Aufwendung (Zahlung)/Rückerstattung von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	(211,281)	(631,573)	39,041
NETTOERTRÄGE AUS ANLAGEN		15,760,535	46,700,370	13,194,995
Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) aus:				
- Anlagen	2	(3,145,550)	(34,970,425)	(33,920,108)
- Devisenterminkontrakten	2	(3,382,561)	50,767,685	(18,435,515)
- Finanzterminkontrakten	2	1,029,507	3,748,910	(5,978,646)
- Swap-Vereinbarungen	2	(441,859)	(11,968,277)	1,896,425
- Optionen	2	(249,510)	–	–
- Devisengeschäften		(42,395)	639,209	(1,003,489)
NETTOANLAGEERTRÄGE UND REALISIERTE WERTANSTIEGE/(-RÜCKGÄNGE)		9,528,167	54,917,472	(44,246,338)

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

		BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund USD	BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund USD	BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund USD
ERTRÄGE	Erläuterung			
Dividende (nach Abzug der Quellensteuer)	2	–	–	–
Zinserträge aus Anlagen (abzüglich Quellensteuer)	2	20,096,830	13,285,069	15,041,664
Zinserträge aus Swap-Vereinbarungen		–	842,277	233,800
Bankzinsen		362,125	1,057,414	515,541
Sonstige Erträge		72,856	1,814	4,176
Summe Erträge		20,531,811	15,186,574	15,795,181
AUFWENDUNGEN				
Verwaltungsgebühren	6	1,203,598	2,204,889	1,310,047
Performancegebühren	6	–	3,068,196	–
Abonnementsteuer („taxe d'abonnement“)	3	56,305	64,684	50,017
Honorar der Geschäftsführung	7	3,649	3,649	3,649
Administrationsgebühren	5	95,104	100,680	125,784
Depotgebühren	5	31,331	28,909	26,476
Honorare		10,884	14,402	15,007
Transaktionskosten	2	3,590	55,967	1,086
Zinsaufwendungen aus Anlagen	2	–	–	–
Zinsaufwendungen aus Swap-Vereinbarungen		500,662	4,818,696	11,509
Bankzinsen		280	163	1
Sonstige Aufwendungen		81,454	75,818	69,554
Summe Aufwendungen		1,986,857	10,436,053	1,613,130
Aufwendung (Zahlung)/Rückerstattung von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	(143,435)	(138,317)	(83,367)
NETTOERTRÄGE AUS ANLAGEN		18,401,519	4,612,204	14,098,684
Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) aus:				
- Anlagen	2	(9,709,869)	(5,350,274)	(8,116,153)
- Devisenterminkontrakten	2	(9,174,912)	4,789,594	14,790,773
- Finanzterminkontrakten	2	(239,593)	6,045,097	(805,293)
- Swap-Vereinbarungen	2	10,173	11,574,420	379,863
- Optionen	2	31,972	–	–
- Devisengeschäften		(60,676)	(1,533,663)	(36,852)
NETTOANLAGEERTRÄGE UND REALISIERTE WERTANSTIEGE/(-RÜCKGÄNGE)		(741,386)	20,137,378	20,311,022

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

	<u>Erläuterung</u>	<u>BlueBay Investment Grade Structured Credit Fund EUR</u>	<u>BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund USD</u>	<u>BlueBay High Grade Structured Credit Short Duration Fund EUR</u>
ERTRÄGE				
Dividende (nach Abzug der Quellensteuer)	2	–	–	–
Zinserträge aus Anlagen (abzüglich Quellensteuer)	2	7,470,062	2,854,120	3,015,452
Zinserträge aus Swap-Vereinbarungen		–	–	–
Bankzinsen		294,298	53,422	110,774
Sonstige Erträge		739	27,113	–
Summe Erträge		7,765,099	2,934,655	3,126,226
AUFWENDUNGEN				
Verwaltungsgebühren	6	281,841	142,228	100,191
Performancegebühren	6	–	–	–
Abonnementsteuer („taxe d'abonnement“)	3	35,392	10,360	7,434
Honorar der Geschäftsführung	7	3,304	3,649	3,305
Administrationsgebühren	5	71,175	14,877	28,637
Depotgebühren	5	12,110	–	–
Honorare		10,262	8,261	8,770
Transaktionskosten	2	8	395	–
Zinsaufwendungen aus Anlagen	2	–	–	–
Zinsaufwendungen aus Swap-Vereinbarungen		–	19,730	784
Bankzinsen		–	44	–
Sonstige Aufwendungen		54,536	32,955	22,185
Summe Aufwendungen		468,628	232,499	171,306
Aufwendung (Zahlung)/Rückerstattung von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	39,022	12,588	9,923
NETTOERTRÄGE AUS ANLAGEN		7,335,493	2,714,744	2,964,843
Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) aus:				
- Anlagen	2	799,753	(419,156)	87,553
- Devisenterminkontrakten	2	(1,321,273)	(1,507,629)	(375,063)
- Finanzterminkontrakten	2	8,506	38,001	–
- Swap-Vereinbarungen	2	–	–	–
- Optionen	2	–	6,910	–
- Devisengeschäften		(114,767)	(5,560)	(98,652)
NETTOANLAGEERTRÄGE UND REALISIERTE WERTANSTIEGE/(-RÜCKGÄNGE)		6,707,712	827,310	2,578,681

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

		BlueBay Investment Grade ESG Bond Fund EUR	BlueBay Impact – Aligned Bond Fund USD	BlueBay Investment Grade Global Government Bond Fund USD
	<u>Erläuterung</u>			
ERTRÄGE				
Dividende (nach Abzug der Quellensteuer)	2	–	–	–
Zinserträge aus Anlagen (abzüglich Quellensteuer)	2	410,772	2,947,876	3,634,455
Zinserträge aus Swap-Vereinbarungen		3,046	–	763,248
Bankzinsen		21,727	159,061	230,601
Sonstige Erträge		31	5,292	–
Summe Erträge		435,576	3,112,229	4,628,304
AUFWENDUNGEN				
Verwaltungsgebühren	6	45,143	186,761	326,230
Performancegebühren	6	–	–	–
Abonnementsteuer („taxe d'abonnement“)	3	3,278	20,048	32,868
Honorar der Geschäftsführung	7	3,305	3,649	3,649
Administrationsgebühren	5	4,818	30,050	48,022
Depotgebühren	5	–	–	–
Honorare		7,704	8,165	9,326
Transaktionskosten	2	780	6,091	12,322
Zinsaufwendungen aus Anlagen	2	–	–	–
Zinsaufwendungen aus Swap-Vereinbarungen		48,822	1,808	797,988
Bankzinsen		–	134	780
Sonstige Aufwendungen		26,440	26,907	54,322
Summe Aufwendungen		140,290	283,613	1,285,507
Aufwendung (Zahlung)/Rückerstattung von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	32,485	12,151	44,421
NETTOERTRÄGE AUS ANLAGEN		327,771	2,840,767	3,387,218
Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) aus:				
- Anlagen	2	(391,736)	(2,800,344)	(2,500,687)
- Devisenterminkontrakten	2	(144,438)	3,085,025	8,310,037
- Finanzterminkontrakten	2	88,587	(2,400,677)	(1,990,093)
- Swap-Vereinbarungen	2	(82,323)	–	1,328,227
- Optionen	2	–	–	–
- Devisengeschäften		28,793	(98,055)	(296,021)
NETTOANLAGEERTRÄGE UND REALISIERTE WERTANSTIEGE/(-RÜCKGÄNGE)		(173,346)	626,716	8,238,681

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

	Erläuterung	BlueBay Investment	Konsolidiert
		Grade Financials Plus Bond Fund USD	EUR
ERTRÄGE			
Dividende (nach Abzug der Quellensteuer)	2	–	4,042
Zinserträge aus Anlagen (abzüglich Quellensteuer)	2	709,634	433,107,992
Zinserträge aus Swap-Vereinbarungen		–	17,295,447
Bankzinsen		28,532	18,511,116
Sonstige Erträge		139	500,929
Summe Erträge		738,305	469,419,526
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgebühren	6	60,874	46,619,596
Performancegebühren	6	–	2,958,676
Abonnementsteuer („taxe d'abonnement“)	3	1,304	2,487,912
Honorar der Geschäftsführung	7	3,649	92,500
Administrationsgebühren	5	5,783	2,968,541
Depotgebühren	5	–	918,282
Honorare		22,480	397,456
Transaktionskosten	2	260	664,656
Zinsaufwendungen aus Anlagen	2	–	59
Zinsaufwendungen aus Swap-Vereinbarungen		430	46,663,028
Bankzinsen		–	15,720
Sonstige Aufwendungen		119,025	2,898,292
Summe Aufwendungen		213,805	106,684,718
Aufwendung (Zahlung)/Rückerstattung von Aufwendungen über Höchstgrenze	5	137,608	(2,318,542)
NETTOERTRÄGE AUS ANLAGEN		662,108	360,416,266
Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) aus:			
- Anlagen	2	752,522	(269,673,857)
- Devisenterminkontrakten	2	206,008	(35,504,192)
- Finanzterminkontrakten	2	47,613	22,749,421
- Swap-Vereinbarungen	2	–	1,714,827
- Optionen	2	–	(174,903)
- Devisengeschäften		55,086	6,879,884
NETTOANLAGEERTRÄGE UND REALISIERTE WERTANSTIEGE/(-RÜCKGÄNGE)		1,723,337	86,407,446

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

		BlueBay Emerging Market Bond Fund USD	BlueBay High Yield ESG Bond Fund EUR	BlueBay Investment Grade Bond Fund EUR
	<u>Erläuterung</u>			
Nettoveränderung der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) aus:				
- Anlagen	2	47,114,163	14,259,793	131,043,625
- Devisenterminkontrakten	2	149,158	673,574	15,094,956
- Finanzterminkontrakten	2	(342,430)	161,874	(4,093,254)
- Swap-Vereinbarungen	2	(1,369,783)	–	2,535,505
- Optionen	2	(92,006)	–	–
- Devisengeschäften		47,752	(22,374)	(3,710,161)
ERGEBNIS DER ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM		52,781,112	19,766,928	134,764,077
KAPITALTRANSAKTIONEN				
Einnahmen aus Zeichnungen von Aktien		138,101,215	71,243,931	357,475,975
Ausgaben für die Rücknahme von Aktien		(48,416,365)	(49,053,694)	(273,163,609)
Dividendenzahlungen	4	(12,608)	(45,174)	(105,097)
Reinvestierte Dividenden		–	4,743	198,606
ZUNAHME/(ABNAHME) DES NETTOVERMÖGENS IM BERICHTSZEITRAUM – GESAMT		142,453,354	41,916,734	219,169,952
Anpassung aus der Währungsumrechnung	2	–	–	–
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums		480,339,713	273,935,404	1,956,415,219
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS – GESAMT		622,793,067	315,852,138	2,175,585,171

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

		BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund USD	BlueBay Emerging Market Select Bond Fund USD	BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund USD
Nettoveränderung der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) aus:				
- Anlagen	2	456,382	3,496,396	10,702,617
- Devisenterminkontrakten	2	1,071,465	3,403,133	1,642,007
- Finanzterminkontrakten	2	(8,261)	(274,912)	(249,428)
- Swap-Vereinbarungen	2	(13,567)	(262,658)	(468,981)
- Optionen	2	(5,259)	(6,033)	(28,299)
- Devisengeschäften		7,506	(121,876)	4,230
ERGEBNIS DER ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM		1,767,711	6,653,567	8,056,782
KAPITALTRANSAKTIONEN				
Einnahmen aus Zeichnungen von Aktien		1,819,158	5,627,203	165,511
Ausgaben für die Rücknahme von Aktien		(3,820,209)	(2,326,429)	(9,742,244)
Dividendenzahlungen	4	(3,125)	–	(27,886)
Reinvestierte Dividenden		–	–	67,977
ZUNAHME/(ABNAHME) DES NETTOVERMÖGENS IM BERICHTSZEITRAUM – GESAMT		(236,465)	9,954,341	(1,479,860)
Anpassung aus der Währungsumrechnung	2	–	–	–
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums		23,197,403	76,305,554	187,864,742
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS – GESAMT		22,960,938	86,259,895	186,384,882

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

		BlueBay Global Convertible Bond Fund USD	BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund USD	BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund EUR
	<u>Erläuterung</u>			
Nettoveränderung der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) aus:				
- Anlagen	2	(1,598,019)	25,500,261	136,391,417
- Devisenterminkontrakten	2	312,916	14,422,135	15,831,743
- Finanzterminkontrakten	2	(5,750)	723,735	8,145,527
- Swap-Vereinbarungen	2	–	(4,173,810)	(2,773,696)
- Optionen	2	135,700	(128,784)	–
- Devisengeschäften		17,316	(862,371)	(813,582)
ERGEBNIS DER ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM		(41,082)	25,987,604	192,095,893
KAPITALTRANSAKTIONEN				
Einnahmen aus Zeichnungen von Aktien		16,986	51,364,528	835,539,741
Ausgaben für die Rücknahme von Aktien		(116,647,847)	(91,125,031)	(396,876,803)
Dividendenzahlungen	4	(3,897)	(218,566)	(1,813)
Reinvestierte Dividenden		1,386	14,491	131
ZUNAHME/(ABNAHME) DES NETTOVERMÖGENS IM BERICHTSZEITRAUM – GESAMT		(116,674,454)	(13,976,974)	630,757,149
Anpassung aus der Währungsumrechnung	2	–	–	–
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums		127,390,868	490,518,851	3,034,004,847
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS – GESAMT		10,716,414	476,541,877	3,664,761,996

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

		BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund EUR	BlueBay Global High Yield Bond Fund USD	BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund USD
	<u>Erläuterung</u>			
Nettoveränderung der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) aus:				
- Anlagen	2	149,389,589	107,781,243	4,180,078
- Devisenterminkontrakten	2	22,134,242	2,973,270	2,282,032
- Finanzterminkontrakten	2	(2,282,784)	834,735	(78,794)
- Swap-Vereinbarungen	2	(4,602,819)	2,395,336	(113,742)
- Optionen	2	–	–	(17,704)
- Devisengeschäften		(2,230,967)	256,038	(1,199)
ERGEBNIS DER ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM		132,364,437	139,307,274	3,882,393
KAPITALTRANSAKTIONEN				
Einnahmen aus Zeichnungen von Aktien		320,532,750	148,301,148	–
Ausgaben für die Rücknahme von Aktien		(289,062,985)	(277,058,823)	(158,876)
Dividendenzahlungen	4	(2,933,763)	(3,809,631)	–
Reinvestierte Dividenden		–	16,787	–
ZUNAHME/(ABNAHME) DES NETTOVERMÖGENS IM BERICHTSZEITRAUM – GESAMT		160,900,439	6,756,755	3,723,517
Anpassung aus der Währungsumrechnung	2	–	–	–
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums		2,243,402,534	1,561,395,616	111,691,260
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS – GESAMT		2,404,302,973	1,568,152,371	115,414,777

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

		BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund EUR	BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund USD	BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund USD
Nettoveränderung der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) aus:				
- Anlagen	2	58,831,647	5,319,303	116,662,920
- Devisenterminkontrakten	2	19,137,886	1,374,806	(2,238,026)
- Finanzterminkontrakten	2	(21,477,793)	49,414	5,979,973
- Swap-Vereinbarungen	2	(622,901)	(44,976)	3,209,503
- Optionen	2	–	(13,278)	–
- Devisengeschäften		(308,207)	5,102	(130,130)
ERGEBNIS DER ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM		33,722,660	4,827,631	140,558,785
KAPITALTRANSAKTIONEN				
Einnahmen aus Zeichnungen von Aktien		64,351,074	10,010,572	761,237,067
Ausgaben für die Rücknahme von Aktien		(171,779,808)	(14,318,850)	(627,092,016)
Dividendenzahlungen	4	(1,554,368)	–	(14,151,618)
Reinvestierte Dividenden		1,570,632	44,907	5,292
ZUNAHME/(ABNAHME) DES NETTOVERMÖGENS IM BERICHTSZEITRAUM – GESAMT		(73,689,810)	564,260	260,557,510
Anpassung aus der Währungsumrechnung	2	–	–	–
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums		896,912,626	80,100,148	1,896,610,280
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS – GESAMT		823,222,816	80,664,408	2,157,167,790

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

		BlueBay Total Return Credit Fund USD	BlueBay Financial Capital Bond Fund USD	BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund USD
	<u>Erläuterung</u>			
Nettoveränderung der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) aus:				
- Anlagen	2	23,363,241	177,666,809	74,691,622
- Devisenterminkontrakten	2	3,872,572	(48,852,601)	50,358,016
- Finanzterminkontrakten	2	189,941	2,633,522	(4,221,844)
- Swap-Vereinbarungen	2	1,315,336	10,241,738	56,551
- Optionen	2	390,314	-	-
- Devisengeschäften		76,085	202,312	(124,133)
ERGEBNIS DER ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM		38,735,656	196,809,252	76,513,874
KAPITALTRANSAKTIONEN				
Einnahmen aus Zeichnungen von Aktien		6,218,732	99,784,714	270,298,716
Ausgaben für die Rücknahme von Aktien		(105,302,671)	(253,662,144)	(42,701,285)
Dividendenzahlungen	4	(3,834,587)	-	-
Reinvestierte Dividenden		8,245	4,609,574	-
ZUNAHME/(ABNAHME) DES NETTOVERMÖGENS IM BERICHTSZEITRAUM – GESAMT		(64,174,625)	47,541,396	304,111,305
Anpassung aus der Währungsumrechnung	2	-	-	-
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums		605,430,561	1,627,033,752	812,456,028
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS – GESAMT		541,255,936	1,674,575,148	1,116,567,333

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

		BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund USD	BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund USD	BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund USD
	<u>Erläuterung</u>	<u>USD</u>	<u>USD</u>	<u>USD</u>
Nettoveränderung der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) aus:				
- Anlagen	2	30,291,664	21,952,537	33,491,006
- Devisenterminkontrakten	2	12,048,456	6,079,441	4,120,583
- Finanzterminkontrakten	2	282,446	(1,972,718)	332,473
- Swap-Vereinbarungen	2	(1,918,453)	(13,076,903)	90,896
- Optionen	2	(90,263)	(613,166)	–
- Devisengeschäften		53,322	704,112	11,547
ERGEBNIS DER ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM		39,925,786	33,210,681	58,357,527
KAPITALTRANSAKTIONEN				
Einnahmen aus Zeichnungen von Aktien		196,278,755	92,450,902	94,633,176
Ausgaben für die Rücknahme von Aktien		(37,054,217)	(75,822,625)	(248,922,624)
Dividendenzahlungen	4	(2,738,115)	(4,490)	(2,379,645)
Reinvestierte Dividenden		162	2,757,737	459,987
ZUNAHME/(ABNAHME) DES NETTOVERMÖGENS IM BERICHTSZEITRAUM – GESAMT		196,412,371	52,592,205	(97,851,579)
Anpassung aus der Währungsumrechnung	2	–	–	–
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums		387,247,073	429,370,750	580,095,192
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS – GESAMT		583,659,444	481,962,955	482,243,613

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

	<u>Erläuterung</u>	<u>BlueBay Investment Grade Structured Credit Fund EUR</u>	<u>BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund USD</u>	<u>BlueBay High Grade Structured Credit Short Duration Fund EUR</u>
Nettoveränderung der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) aus:				
- Anlagen	2	1,142,532	1,238,404	124,912
- Devisenterminkontrakten	2	(85,982)	1,410,166	457,563
- Finanzterminkontrakten	2	(8,755)	(44,953)	–
- Swap-Vereinbarungen	2	–	(79,812)	–
- Optionen	2	–	(8,850)	–
- Devisengeschäften		178	2,053	207
ERGEBNIS DER ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM		7,755,685	3,344,318	3,161,363
KAPITALTRANSAKTIONEN				
Einnahmen aus Zeichnungen von Aktien		46,825,678	24,300,730	28,550,404
Ausgaben für die Rücknahme von Aktien		(12,577,050)	(10,485,582)	(103,361)
Dividendenzahlungen	4	(6,546)	(35,219)	–
Reinvestierte Dividenden		4,437	89	–
ZUNAHME/(ABNAHME) DES NETTOVERMÖGENS IM BERICHTSZEITRAUM – GESAMT		42,002,204	17,124,336	31,608,406
Anpassung aus der Währungsumrechnung	2	–	–	–
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums		231,042,493	50,236,225	104,453,220
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS – GESAMT		273,044,697	67,360,561	136,061,626

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

		BlueBay Investment Grade ESG Bond Fund EUR	BlueBay Impact – Aligned Bond Fund USD	BlueBay Investment Grade Global Government Bond Fund USD
	<u>Erläuterung</u>			
Nettoveränderung der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) aus:				
- Anlagen	2	1,240,756	9,421,687	7,323,841
- Devisenterminkontrakten	2	150,211	(1,934,491)	(7,357,948)
- Finanzterminkontrakten	2	(49,484)	1,232,200	2,750,581
- Swap-Vereinbarungen	2	28,613	–	63,181
- Optionen	2	–	–	–
- Devisengeschäften		(38,626)	25,073	58,446
ERGEBNIS DER ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM		1,158,124	9,371,185	11,076,782
KAPITALTRANSAKTIONEN				
Einnahmen aus Zeichnungen von Aktien		1,032,373	68,593,889	77,619,833
Ausgaben für die Rücknahme von Aktien		(287,151)	(10,262,028)	(21,786,298)
Dividendenzahlungen	4	–	(192,557)	(29)
Reinvestierte Dividenden		–	263	–
ZUNAHME/(ABNAHME) DES NETTOVERMÖGENS IM BERICHTSZEITRAUM – GESAMT		1,903,346	67,510,752	66,910,288
Anpassung aus der Währungsumrechnung	2	–	–	–
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums		19,058,270	96,560,758	169,141,488
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS – GESAMT		20,961,616	164,071,510	236,051,776

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

		BlueBay Investment Grade Financials Plus Bond Fund	Konsolidiert
	<u>Erläuterung</u>	<u>USD</u>	<u>EUR</u>
Nettoveränderung der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) aus:			
- Anlagen	2	3,968,309	1,128,847,099
- Devisenterminkontrakten	2	(1,347,172)	113,035,635
- Finanzterminkontrakten	2	(48,226)	(12,578,277)
- Swap-Vereinbarungen	2	–	(9,192,274)
- Optionen	2	–	(432,380)
- Devisengeschäften		23,631	(6,892,856)
ERGEBNIS DER ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM		4,319,879	1,299,194,393
KAPITALTRANSAKTIONEN			
Einnahmen aus Zeichnungen von Aktien		40,044,087	3,614,717,689
Ausgaben für die Rücknahme von Aktien		(10,729,000)	(3,010,163,503)
Dividendenzahlungen	4	(900)	(29,462,651)
Reinvestierte Dividenden		–	9,008,800
ZUNAHME/(ABNAHME) DES NETTOVERMÖGENS IM BERICHTSZEITRAUM – GESAMT		33,634,066	1,883,294,728
Anpassung aus der Währungsumrechnung	2	–	(111,029,484)
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums		9,933,843	17,744,486,013
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS – GESAMT		43,567,909	19,516,751,257

Die beigefügten Erläuterungen bilden einen integralen Bestandteil des Abschlusses.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben

Total Expense Ratios^

31. Dezember
2023

Teilfonds

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund

- B - CHF	1.20%
- B - EUR	1.20%
- B - GBP	1.20%
- B - USD	1.20%
- C - EUR	0.90%
- C - GBP	0.90%
- C - GBP (AIDiv)	0.90%
- C - USD	0.90%
- C - USD (AIDiv)	0.90%
- D - GBP (QIDiv)	1.20%
- DR - GBP (QIDiv)	1.70%
- I - EUR	1.16%
- I - NOK	1.16%
- I - USD	1.16%
- M - EUR	1.20%
- M - USD	1.20%
- Q - CHF	0.80%
- Q - EUR*	0.80%
- Q - USD	0.80%
- R - EUR	1.70%
- R - EUR (AIDiv)	1.70%
- R - USD	1.70%
- R - USD (AIDiv)	1.70%
- S - EUR	0.65%
- S - GBP	0.65%
- S - GBP (AIDiv)	0.65%
- S - USD	0.65%
- S - USD (AIDiv)	0.65%
- Y - USD	0.16%

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben (Fortsetzung)

Total Expense Ratios^ (Fortsetzung)

31. Dezember
2023

Teilfonds

BlueBay Funds – BlueBay High Yield ESG Bond Fund

- B - EUR	0.86%
- B - EUR (Perf)	0.66%
- B - GBP	0.86%
- B - USD	0.86%
- C - CHF	0.76%
- C - EUR	0.76%
- C - EUR (AIDiv)	0.76%
- C - GBP (AIDiv)	0.76%
- C - USD	0.76%
- C - USD (AIDiv)	0.76%
- D - GBP (QIDiv)	0.86%
- DR - GBP (QIDiv)	1.41%
- I - CHF	0.82%
- I - EUR	0.82%
- I - EUR (AIDiv)	0.82%
- I - EUR (Perf)	0.62%
- I - USD	0.82%
- I - USD (AIDiv)	0.82%
- I - USD (Perf)	0.62%
- M - EUR	0.86%
- M - USD*	0.86%
- M - USD (MIDiv)*	0.86%
- Q - EUR	0.71%
- Q - USD	0.71%
- R - CHF	1.41%
- R - EUR	1.41%
- R - EUR (AIDiv)	1.41%
- R - NOK	1.41%
- R - SEK	1.41%
- R - USD	1.41%
- R - USD (AIDiv)	1.41%
- S - CHF	0.66%
- S - EUR	0.66%
- S - EUR (AIDiv)*	0.66%
- S - GBP	0.66%
- S - GBP (AIDiv)	0.66%
- S - JPY	0.66%
- S - USD	0.66%
- S - USD (AIDiv)*	0.66%
- V - EUR*	0.55%
- V - GBP (QIDiv)*	0.55%
- V - USD*	0.55%
- V - USD (QIDiv)*	0.55%
- Y - EUR*	0.16%

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben (Fortsetzung)

Total Expense Ratios^ (Fortsetzung)

31. Dezember
2023

Teilfonds

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund

- B - CHF	0.66%
- B - EUR	0.66%
- B - EUR (Perf)	0.46%
- B - GBP	0.66%
- B - JPY	0.66%
- B - USD	0.66%
- B - USD (Perf)	0.46%
- C - EUR	0.61%
- C - EUR (AIDiv)	0.61%
- C - GBP	0.61%
- C - GBP (AIDiv)	0.61%
- C - USD	0.61%
- C - USD (AIDiv)	0.61%
- D - GBP (QIDiv)	0.66%
- DR - GBP (QIDiv)	0.91%
- I - CHF	0.57%
- I - EUR	0.57%
- I - EUR (AIDiv)	0.57%
- I - EUR (Perf)	0.37%
- I - GBP	0.57%
- I - USD	0.57%
- I - USD (Perf)	0.37%
- M - CHF	0.61%
- M - EUR	0.61%
- M - GBP*	0.61%
- M - USD	0.61%
- Q - CHF	0.56%
- Q - EUR	0.56%
- Q - EUR (AIDiv)	0.56%
- Q - USD	0.56%
- R - CHF	0.91%
- R - EUR	0.91%
- R - EUR (AIDiv)	0.91%
- R - GBP	0.91%
- R - NOK	0.91%
- R - SEK	0.91%
- R - USD	0.91%
- R - USD (AIDiv)	0.91%
- S - CHF	0.51%
- S - CHF (AIDiv)	0.51%
- S - EUR	0.51%
- S - EUR (AIDiv)	0.51%
- S - GBP	0.51%
- S - GBP (AIDiv)	0.51%
- S - USD	0.51%
- S - USD (AIDiv)	0.51%
- Y - EUR	0.16%

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben (Fortsetzung)

Total Expense Ratios^ (Fortsetzung)

Teilfonds	31. Dezember 2023
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund	
- B - EUR	0.80%
- B - USD	0.80%
- C - EUR	0.70%
- C - GBP (AIDiv)	0.70%
- C - USD	0.70%
- C - USD (AIDiv)	0.70%
- D - GBP (QIDiv)	0.80%
- DR - GBP (QIDiv)	1.40%
- G - USD	1.40%
- M - EUR	0.80%
- Q - CHF	0.60%
- Q - EUR	0.60%
- R - CHF	1.40%
- R - EUR	1.40%
- R - EUR (AIDiv)	1.40%
- R - SEK	1.40%
- R - USD	1.40%
- R - USD (AIDiv)	1.40%
- S - GBP (AIDiv)	0.55%
- S - USD	0.55%

Teilfonds	31. Dezember 2023
-----------	----------------------

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Select Bond Fund	
- B - EUR	0.85%
- B - USD	0.85%
- C - EUR	0.75%
- I - EUR	0.81%
- M - EUR	0.85%
- R - EUR	1.45%
- R - NOK	1.45%
- R - SEK	1.45%
- R - USD	1.45%

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben (Fortsetzung)

Total Expense Ratios^ (Fortsetzung)

31. Dezember
2023

Teilfonds

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund

- B - CHF	1.40%
- B - EUR	1.40%
- B - USD	1.40%
- C - EUR	1.20%
- C - EUR (AIDiv)	1.20%
- C - GBP (AIDiv)	1.20%
- C - USD	1.20%
- C - USD (AIDiv)	1.20%
- DR - GBP (QIDiv)	1.70%
- I - EUR	1.36%
- I - EUR (Perf)	0.96%
- I - USD	1.36%
- I - USD (Perf)	0.96%
- M - EUR	1.40%
- Q - EUR (AIDiv)	1.00%
- Q - USD	1.00%
- R - CHF	1.70%
- R - EUR	1.70%
- R - EUR (AIDiv)	1.70%
- R - NOK	1.70%
- R - SGD (MIDiv)	1.70%
- R - USD	1.70%
- R - USD (AIDiv)	1.70%
- S - CHF	0.80%
- S - EUR	0.80%
- S - EUR (AIDiv)	0.80%
- S - GBP (AIDiv)	0.80%
- S - NOK	0.80%
- S - USD	0.80%
- S - USD (AIDiv)	0.80%
- X - GBP	0.16%
- X - USD	0.16%

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben (Fortsetzung)

Total Expense Ratios^ (Fortsetzung)

Teilfonds	31. Dezember 2023
BlueBay Funds – BlueBay Global Convertible Bond Fund	
- B - EUR	0.95%
- B - GBP	0.95%
- B - GBP (BHedged)*	0.95%
- B - USD	0.95%
- B - USD (Perf)-(BHedged)	0.80%
- D - GBP (QIDiv)	0.95%
- DR - GBP (QIDiv)	1.70%
- I - USD	0.91%
- I - USD (Perf)*	0.76%
- R - CHF	1.70%
- R - EUR	1.70%
- R - EUR (AIDiv)	1.70%
- R - USD	1.70%
- R - USD (AIDiv)	1.70%
- S - CHF (BHedged)	0.70%
- S - USD	0.70%
- X - EUR	0.16%
- X - GBP	0.16%
- X - USD	0.16%

Teilfonds	31. Dezember 2023
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund	
- C - EUR (QIDiv)	0.90%
- C - GBP	0.90%
- C - USD	0.90%
- C - USD (QIDiv)	0.90%
- ER - SEK	1.45%
- G - EUR (Perf)	0.90%
- I - EUR	1.11%
- I - USD	1.11%
- K - EUR	0.61%
- M - EUR	1.15%
- M - USD	1.15%
- Q - EUR	0.85%
- Q - GBP*	0.85%
- Q - GBP (QIDiv)*	0.85%
- Q - USD*	0.85%
- R - CHF*	1.70%
- R - EUR*	1.70%
- R - USD*	1.70%
- S - CAD (QIDiv)	0.75%
- S - EUR	0.75%
- S - GBP	0.75%
- S - GBP (QIDiv)	0.75%
- S - USD	0.75%
- X - EUR	0.16%
- X - GBP	0.16%
- X - USD	0.16%

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben (Fortsetzung)

Total Expense Ratios^ (Fortsetzung)

Teilfonds	31. Dezember 2023
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund	
- B - EUR	0.70%
- B - USD	0.70%
- C - EUR	0.41%
- I - EUR	0.57%
- I - EUR (AIDiv)	0.57%
- I - USD	0.57%
- K - EUR	0.27%
- M - EUR	0.61%
- M - USD	0.61%
- Q - CHF	0.36%
- Q - EUR	0.36%
- Q - EUR (AIDiv)	0.36%
- Q - USD	0.36%
- R - CHF	0.95%
- R - EUR	0.95%
- R - EUR (AIDiv)	0.95%
- R - GBP	0.95%
- R - USD	0.95%
- S - EUR	0.31%
- S - EUR (QIDiv)	0.31%

Teilfonds	31. Dezember 2023
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund	
- B - CHF	0.70%
- B - EUR	0.70%
- B - USD	0.70%
- C - EUR	0.46%
- C - EUR (AIDiv)	0.46%
- I - EUR	0.57%
- I - EUR (AIDiv)	0.57%
- I - EUR (QIDiv)	0.57%
- I - USD	0.57%
- M - EUR	0.61%
- M - USD	0.61%
- Q - CHF	0.41%
- Q - EUR	0.41%
- Q - EUR (AIDiv)	0.41%
- R - EUR	0.95%
- R - EUR (AIDiv)	0.95%
- R - NOK	0.95%
- R - USD	0.95%
- S - EUR	0.36%
- S - EUR (QIDiv)	0.36%
- S - JPY	0.36%

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben (Fortsetzung)

Total Expense Ratios^ (Fortsetzung)

31. Dezember
2023

Teilfonds

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund

- B - CHF	0.90%
- B - EUR	0.90%
- B - EUR (AIDiv)	0.90%
- B - GBP	0.90%
- B - USD	0.90%
- B - USD (AIDiv)	0.90%
- C - CHF	0.80%
- C - EUR	0.80%
- C - EUR (AIDiv)	0.80%
- C - GBP	0.80%
- C - GBP (AIDiv)	0.80%
- C - USD	0.80%
- C - USD (AIDiv)	0.80%
- D - GBP (QIDiv)	0.90%
- I - EUR	0.86%
- I - EUR (AIDiv)	0.86%
- I - EUR (Perf)	0.66%
- I - GBP	0.86%
- I - NOK	0.86%
- I - SEK	0.86%
- I - USD	0.86%
- M - EUR	0.90%
- Q - CHF	0.75%
- Q - EUR	0.75%
- Q - EUR (AIDiv)	0.75%
- Q - GBP (QIDiv)	0.75%
- Q - SEK*	0.75%
- Q - USD	0.75%
- Q - USD (QIDiv)	0.75%
- R - CHF	1.45%
- R - EUR	1.45%
- R - NOK	1.45%
- R - USD	1.45%
- S - EUR	0.70%
- S - GBP	0.70%
- S - GBP (AIDiv)	0.70%
- S - USD	0.70%
- S - USD (QIDiv)	0.70%
- X - EUR	0.16%
- X - GBP	0.16%
- X - USD	0.16%

31. Dezember
2023

Teilfonds

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund

- B - EUR	1.20%
- I - EUR (AIDiv)	1.16%
- R - EUR	1.70%

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben (Fortsetzung)

Total Expense Ratios^ (Fortsetzung)

31. Dezember
2023

Teilfonds

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund

- B - CHF	1.20%
- B - EUR	1.20%
- B - EUR (AIDiv)	1.20%
- B - EUR (Perf)	0.80%
- B - GBP	1.20%
- B - USD	1.20%
- C - EUR	0.94%
- C - GBP	0.94%
- C - GBP (AIDiv)	0.94%
- C - USD	0.94%
- C - USD (AIDiv)	0.94%
- D - GBP (QIDiv)	1.20%
- I - CHF	1.10%
- I - EUR	1.10%
- I - EUR (AIDiv)	1.10%
- I - EUR (Perf)	0.70%
- I - NOK	1.10%
- I - USD	1.10%
- I - USD (AIDiv)	1.10%
- K - EUR (QKDiv)	0.70%
- M - CHF*	1.14%
- M - EUR	1.14%
- M - USD	1.14%
- Q - CHF	0.84%
- Q - EUR	0.84%
- Q - EUR (AIDiv)	0.84%
- Q - GBP (AIDiv)	0.84%
- Q - USD*	0.84%
- R - EUR	1.70%
- R - EUR (AIDiv)	1.70%
- R - USD	1.70%
- R - USD (AIDiv)	1.70%
- S - CHF	0.74%
- S - CHF (AIDiv)	0.74%
- S - EUR	0.74%
- S - GBP	0.74%
- S - GBP (AIDiv)	0.74%
- S - JPY	0.74%
- S - USD	0.74%
- X - GBP	0.16%
- X - USD	0.16%
- Y - EUR	0.16%

31. Dezember
2023

Teilfonds

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund

- C - EUR	1.50%
- I - EUR	1.66%
- I - NOK	1.66%
- I - USD*	1.66%
- I - USD (Perf)*	1.26%
- R - USD (AIDiv)	2.20%

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben (Fortsetzung)

Total Expense Ratios^ (Fortsetzung)

31. Dezember
2023

Teilfonds

BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund

- B - EUR	0.66%
- B - USD	0.66%
- C - EUR	0.56%
- C - EUR (AIDiv)	0.56%
- C - GBP*	0.56%
- C - USD	0.56%
- C - USD (AIDiv)	0.56%
- I - EUR	0.57%
- I - EUR (AIDiv)	0.57%
- I - GBP*	0.57%
- I - USD	0.57%
- I - USD (MIDiv)	0.57%
- M - CHF	0.61%
- M - EUR	0.61%
- M - USD	0.61%
- Q - CHF (QIDiv)	0.51%
- Q - EUR	0.51%
- Q - EUR (AIDiv)	0.51%
- Q - GBP	0.51%
- Q - GBP (QIDiv)	0.51%
- Q - USD	0.51%
- Q - USD (QIDiv)	0.51%
- R - CHF	0.91%
- R - CHF (AIDiv)	0.91%
- R - CHF (QIDiv)	0.91%
- R - EUR	0.91%
- R - EUR (QIDiv)	0.91%
- R - GBP	0.91%
- R - GBP (QIDiv)	0.91%
- R - USD	0.91%
- R - USD (QIDiv)*	0.91%
- S - AUD (QIDiv)	0.46%
- S - CHF	0.46%
- S - EUR	0.46%
- S - EUR (QIDiv)	0.46%
- S - GBP	0.46%
- S - GBP (QIDiv)	0.46%
- S - JPY	0.46%
- S - USD	0.46%
- S - USD (QIDiv)	0.46%
- X - EUR	0.16%
- X - GBP	0.16%
- X - USD	0.16%
- Y - CAD	0.16%
- Y - GBP*	0.16%
- Y - GBP (MIDiv)*	0.16%

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben (Fortsetzung)

Total Expense Ratios^ (Fortsetzung)

Teilfonds	31. Dezember 2023
BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund	
- B - USD	0.90%
- C - EUR	0.80%
- C - EUR (QIDiv)*	0.80%
- C - GBP (QIDiv)	0.80%
- C - USD	0.80%
- C - USD (QIDiv)	0.80%
- I - AUD	0.86%
- I - EUR	0.86%
- I - GBP	0.86%
- I - GBP (QIDiv)	0.86%
- I - NOK	0.86%
- I - USD	0.86%
- M - EUR*	0.90%
- M - NOK	0.90%
- S - JPY	0.65%

Teilfonds	31. Dezember 2023
-----------	----------------------

BlueBay Funds – BlueBay Financial Capital Bond Fund

- B - USD	1.00%
- C - CHF (AIDiv)	0.90%
- C - EUR	0.90%
- C - EUR (AIDiv)	0.90%
- C - GBP	0.90%
- C - GBP (AIDiv)	0.90%
- C - USD	0.90%
- C - USD (AIDiv)	0.90%
- G - EUR (AIDiv)	0.70%
- G - GBP	0.70%
- G - GBP (AIDiv)	0.70%
- G - USD (AIDiv)	0.70%
- I - EUR	0.96%
- I - GBP (AIDiv)	0.96%
- I - NOK	0.96%
- I - SEK	0.96%
- I - USD	0.96%
- K - CHF*	0.66%
- K - EUR	0.66%
- K - GBP	0.66%
- K - GBP (AIDiv)	0.66%
- K - USD	0.66%
- K - USD (AIDiv)	0.66%
- M - CHF	1.00%
- M - EUR	1.00%
- M - EUR (AIDiv)	1.00%
- M - GBP	1.00%
- M - USD	1.00%
- M - USD (AIDiv)	1.00%
- Q - CHF	0.85%
- Q - EUR	0.85%
- Q - SEK	0.85%
- Q - USD	0.85%
- Q - USD (AIDiv)	0.85%
- R - EUR	1.50%
- R - EUR (AIDiv)	1.50%

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben (Fortsetzung)

Total Expense Ratios^ (Fortsetzung)

Teilfonds	31. Dezember 2023
- R - SEK	1.50%
- R - USD	1.50%
- R - USD (AIDiv)	1.50%
- S - EUR	0.80%
- S - EUR (AIDiv)	0.80%
- S - GBP	0.80%
- S - USD	0.80%
- X - EUR	0.16%
- X - GBP	0.16%
- X - USD	0.16%

Teilfonds	31. Dezember 2023
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund	
- C - USD (BHedged)	0.46%
- I - EUR (BHedged)	0.57%
- I - NOK (BHedged)	0.57%
- I - USD (BHedged)	0.57%
- M - EUR (AIDiv)-(BHedged)	0.61%
- M - EUR (BHedged)	0.61%
- M - NOK (BHedged)	0.61%
- Q - EUR*	0.41%
- Q - JPY (BHedged)	0.41%
- R - USD	0.95%

Teilfonds	31. Dezember 2023
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund	
- B - USD	0.90%
- I - AUD	0.86%
- I - USD	0.86%
- K - GBP*	0.46%
- K - GBP (MIDiv)*	0.46%
- M - EUR	0.90%
- Q - EUR (QIDiv)	0.80%
- R - USD	1.50%
- S - EUR	0.75%
- S - JPY	0.75%
- S - USD	0.75%
- Y - CAD	0.16%

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben (Fortsetzung)

Total Expense Ratios^ (Fortsetzung)

Teilfonds	31. Dezember 2023
BlueBay Funds – BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund	
- A - USD (CPerf)	1.80%
- C - EUR (CPerf)	1.20%
- C - EUR (CPerf)-(QIDiv)	1.20%
- C - GBP (CPerf)	1.20%
- C - USD (CPerf)	1.20%
- I - CAD (ACDiv)	1.11%
- I - EUR	1.11%
- I - EUR (CPerf)	1.16%
- I - EUR (Perf)	1.16%
- I - GBP (Perf)	1.16%
- I - JPY (Perf)*	1.16%
- I - USD	1.11%
- I - USD (Perf)	1.16%
- M - EUR	1.15%
- M - EUR (CPerf)	1.20%
- M - USD (CPerf)	1.20%
- Q - EUR (CPerf)	1.20%
- Q - NOK (CPerf)	1.20%
- Q - SEK (CPerf)	1.20%
- S - USD (CPerf)*	0.60%
- ZR - EUR (CPerf)	0.20%
- ZR - GBP (CPerf)-(AIDiv)	0.20%
- ZR - USD (CPerf)-(AIDiv)	0.20%

Teilfonds	31. Dezember 2023
-----------	----------------------

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund	
- B - USD	0.90%
- C - EUR	0.80%
- C - GBP	0.80%
- C - GBP (AIDiv)	0.80%
- I - EUR	0.86%
- I - NOK	0.86%
- I - USD	0.86%
- K - EUR (AIDiv)	0.61%
- K - USD (AIDiv)	0.61%
- M - USD	0.90%
- Q - EUR	0.75%
- R - EUR	1.45%
- R - USD (AIDiv)	1.45%
- S - EUR	0.70%
- S - EUR (QIDiv)	0.70%
- S - GBP	0.70%
- S - GBP (QIDiv)	0.70%
- S - USD	0.70%
- S - USD (QIDiv)	0.70%

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben (Fortsetzung)

Total Expense Ratios^ (Fortsetzung)

Teilfonds	31. Dezember 2023
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Structured Credit Fund	
- G - EUR	0.29%
- G - GBP	0.29%
- G - GBP (QIDiv)	0.29%
- G - USD	0.29%
- G - USD (QIDiv)	0.29%
- I - EUR (AIDiv)	0.45%
- I - USD	0.45%
- K - EUR	0.25%
- M - EUR	0.49%
- Q - EUR	0.39%
- Q - GBP	0.39%
- Q - USD	0.39%
- S - EUR	0.34%
- S - GBP	0.34%
- S - USD	0.34%

Teilfonds	31. Dezember 2023
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund	
- G - EUR	0.60%
- G - GBP	0.60%
- G - GBP (AIDiv)	0.60%
- G - USD	0.60%
- G - USD (MIDiv)	0.60%
- I - USD	0.76%
- K - EUR	0.56%
- K - USD	0.56%
- M - EUR	0.80%
- R - EUR*	1.15%
- S - JPY	0.65%
- W - USD	0.90%

Teilfonds	31. Dezember 2023
BlueBay Funds – BlueBay High Grade Structured Credit Short Duration Fund	
- G - EUR*	0.29%
- I - EUR	0.35%
- K - EUR	0.25%
- K - USD*	0.25%

Teilfonds	31. Dezember 2023
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade ESG Bond Fund	
- I - EUR	0.57%
- S - EUR	0.51%

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben (Fortsetzung)

Total Expense Ratios^ (Fortsetzung)

Teilfonds	31. Dezember 2023
BlueBay Funds – BlueBay Impact – Aligned Bond Fund	
- C - GBP	0.54%
- C - GBP (QIDiv)	0.54%
- G - EUR	0.39%
- G - EUR (QIDiv)	0.39%
- G - GBP	0.39%
- G - GBP (QIDiv)	0.39%
- G - USD	0.39%
- I - USD	0.60%
- K - CHF	0.35%
- K - EUR	0.35%
- K - GBP*	0.35%
- K - USD	0.35%
- R - CHF	0.89%
- S - GBP*	0.44%
- S - GBP (QIDiv)*	0.44%
- X - GBP	0.10%
- X - USD	0.10%

Teilfonds	31. Dezember 2023
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Government Bond Fund	
- I - EUR	0.57%
- Q - GBP*	0.36%
- Q - GBP (QIDiv)*	0.36%
- S - CHF*	0.31%
- S - EUR*	0.31%
- S - EUR (AIDiv)	0.31%
- S - GBP*	0.31%
- S - GBP (AIDiv)	0.31%
- S - USD*	0.31%
- S - USD (AIDiv)	0.31%

Teilfonds	31. Dezember 2023
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Financials Plus Bond Fund	
- C - GBP*	0.61%
- C - GBP (QCDiv)*	0.61%
- I - USD	0.62%
- S - GBP*	0.51%
- S - GBP (QIDiv)*	0.51%

^ Jede Aktienklasse trägt einen proportionalen Anteil an den tatsächlichen Kosten, die dem Teilfonds in dem Berichtszeitraum entstanden sind. Der proportionale Anteil an den gesamten Aufwendungen des Teilfonds, mit dem jede Aktienklasse belastet wird, wird entsprechend des durchschnittlichen jährlichen verwalteten Vermögens jeder Aktienklasse und ihrer entsprechenden Höchstgrenze für die Aufwendungen berechnet. Übersteigen die Aufwendungen das kumulierte verwaltete Vermögen der Aktienklasse, multipliziert mit der Höchstgrenze für die Aufwendungen, wird dieser Mehrbetrag von der Verwaltungsgesellschaft übernommen. Die Berechnung der Total Expense Ratios für alle Aktienklassen, die während des Berichtszeitraums aufgelegt oder geschlossen wurden, erfolgte auf annualisierter Basis. Die Total Expense Ratios sind ungeprüft.

* Die im Berichtszeitraum in den Aktienklassen durchgeführten Aktivitäten werden in Anhang 1 beschrieben.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben (Fortsetzung)

In Umlauf befindliche Aktien

Teilfonds	In Umlauf befindliche Aktien zu Beginn des Geschäftsjahrs/ Berichtszeitraums	Gezeichnete Aktien	Reinvestierte Aktien	Zurückgenommene Aktien	In Umlauf befindliche Aktien am Ende des Geschäftsjahrs/ Berichtszeitraums
BlueBay Funds – BlueBay					
Emerging Market Bond Fund					
- B - CHF	131,412	4,950	–	–	136,362
- B - EUR	7,128	–	–	(2,964)	4,164
- B - GBP	1,020	–	–	–	1,020
- B - USD	3,182	7,304	–	–	10,486
- C - EUR	19,590	–	–	(670)	18,920
- C - GBP	3,574	–	–	–	3,574
- C - GBP (AIDiv)	6,084	–	–	(6,049)	35
- C - USD	22,518	49,247	–	(18,530)	53,235
- C - USD (AIDiv)	8,468	–	–	(1,439)	7,029
- D - GBP (QIDiv)	264	–	–	–	264
- DR - GBP (QIDiv)	4,868	–	–	–	4,868
- I - EUR	30,920	8,977	–	(10,808)	29,089
- I - NOK	305,998	94,229	–	(105)	400,122
- I - USD	615,191	351,093	–	(2,313)	963,971
- M - EUR	56,473	69,500	–	(15,474)	110,499
- M - USD	903	–	–	–	903
- Q - CHF	78,183	2,377	–	(14,312)	66,248
- Q - EUR	–	14,521	–	–	14,521
- Q - USD	1,155,052	88,569	–	(189,568)	1,054,053
- R - EUR	12,723	–	–	(2,339)	10,384
- R - EUR (AIDiv)	19,538	705	–	(4,461)	15,782
- R - USD	74,548	574	–	(9,951)	65,171
- R - USD (AIDiv)	36,085	4,465	–	(4,094)	36,456
- S - EUR	256,203	182,027	–	(36,597)	401,633
- S - GBP	1,581	–	–	(600)	981
- S - GBP (AIDiv)	13,814	2,976	–	(525)	16,265
- S - USD	13,134	5,081	–	(3,159)	15,056
- S - USD (AIDiv)	1,383	89,038	–	(390)	90,031
- Y - USD	834,756	47,016	–	(76,885)	804,887
BlueBay Funds – BlueBay High					
Yield ESG Bond Fund					
- B - EUR	62,535	12,783	–	(15,819)	59,499
- B - EUR (Perf)	400	–	–	–	400
- B - GBP	394	101	–	(14)	481
- B - USD	63,601	–	–	(1,560)	62,041
- C - CHF	2,738	116	–	–	2,854
- C - EUR	214,167	21,088	–	(39,577)	195,678
- C - EUR (AIDiv)	10,280	–	52	(2,590)	7,742
- C - GBP (AIDiv)	1,022	–	–	–	1,022
- C - USD	24,828	10,324	–	(13,054)	22,098
- C - USD (AIDiv)	5,198	–	–	–	5,198
- D - GBP (QIDiv)	5,454	–	–	(2,040)	3,414
- DR - GBP (QIDiv)	8,754	626	–	(268)	9,112
- I - CHF	470	–	–	–	470
- I - EUR	145,012	27,977	–	(67,833)	105,156
- I - EUR (AIDiv)	10,515	–	–	–	10,515
- I - EUR (Perf)	87,754	249	–	–	88,003
- I - USD	32,121	495	–	(9,314)	23,302
- I - USD (AIDiv)	10,950	–	–	–	10,950
- I - USD (Perf)	5,279	310	–	(763)	4,826
- M - EUR	16,487	3,742	–	(3,156)	17,073
- M - USD	–	102	–	–	102
- M - USD (MIDiv)	–	115	–	–	115
- Q - EUR	54,671	5,875	–	(2,557)	57,989
- Q - USD	6,862	763	–	(254)	7,371
- R - CHF	8,425	–	–	(649)	7,776
- R - EUR	185,661	2,504	–	(19,519)	168,646
- R - EUR (AIDiv)	157,050	2,052	5	(9,333)	149,774
- R - NOK	13,648	3,978	–	(5,054)	12,572
- R - SEK	18,796	15,568	–	(3,483)	30,881
- R - USD	141,286	35,063	–	(30,356)	145,993
- R - USD (AIDiv)	49,745	465	–	(1,296)	48,914
- S - CHF	1,429	–	–	–	1,429
- S - EUR	21,332	288,223	–	(125)	309,430

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben (Fortsetzung)

In Umlauf befindliche Aktien (Fortsetzung)

Teilfonds	In Umlauf befindliche Aktien zu Beginn des				In Umlauf befindliche Aktien am Ende des
	Geschäftsjahrs/ Berichtszeitraums	Gezeichnete Aktien	Reinvestierte Aktien	Zurückgenommene Aktien	
BlueBay Funds – BlueBay High Yield ESG Bond Fund (Fortsetzung)					
- S - EUR (AIDiv)	–	108	–	–	108
- S - GBP	1,678	–	–	–	1,678
- S - GBP (AIDiv)	2,710	–	–	–	2,710
- S - JPY	195,962	–	–	(92)	195,870
- S - USD	1,705	–	–	–	1,705
- S - USD (AIDiv)	–	115	–	–	115
- V - EUR	–	119	–	–	119
- V - GBP (QIDiv)	–	164	–	–	164
- V - USD	–	102	–	–	102
- V - USD (QIDiv)	–	102	–	–	102
- Y - EUR	11,056	264	–	(664)	10,656
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund					
- B - CHF	31,049	110	–	(10,539)	20,620
- B - EUR	507,020	58,241	–	(67,350)	497,911
- B - EUR (Perf)	1,319	1,390	–	(149)	2,560
- B - GBP	10,868	–	–	(442)	10,426
- B - JPY	5,854	1,121	–	–	6,975
- B - USD	63,186	2,194	–	(19,440)	45,940
- B - USD (Perf)	1,266	–	–	–	1,266
- C - EUR	992,049	160,235	–	(374,731)	777,553
- C - EUR (AIDiv)	103,379	14,453	–	(10,787)	107,045
- C - GBP	13,172	1,213	–	(699)	13,686
- C - GBP (AIDiv)	59,863	3,605	–	(660)	62,808
- C - USD	535,112	27,892	–	(186,873)	376,131
- C - USD (AIDiv)	166,369	37,229	–	(6,780)	196,818
- D - GBP (QIDiv)	27,305	68	–	(5,903)	21,470
- DR - GBP (QIDiv)	19,183	–	–	(606)	18,577
- I - CHF	9,760	500	–	(4,456)	5,804
- I - EUR	3,109,763	379,927	–	(226,683)	3,263,007
- I - EUR (AIDiv)	186,011	–	1,734	(71,779)	115,966
- I - EUR (Perf)	795,868	12,115	–	(41,955)	766,028
- I - GBP	36,821	3,954	–	–	40,775
- I - USD	364,526	33,332	–	(11,112)	386,746
- I - USD (Perf)	43,156	10,371	–	(4)	53,523
- M - CHF	949	–	–	–	949
- M - EUR	862,723	134,859	–	(137,331)	860,251
- M - GBP	35	–	–	(35)	–
- M - USD	983	–	–	–	983
- Q - CHF	15,107	16,662	–	(1,510)	30,259
- Q - EUR	2,445,515	798,024	–	(452,672)	2,790,867
- Q - EUR (AIDiv)	3,459	17,690	–	(1,084)	20,065
- Q - USD	740	32,363	–	–	33,103
- R - CHF	23,136	2,715	–	(1,055)	24,796
- R - EUR	491,640	96,737	–	(57,672)	530,705
- R - EUR (AIDiv)	210,161	10,035	127	(25,455)	194,868
- R - GBP	8,921	–	–	(1,477)	7,444
- R - NOK	177,025	64,765	–	(14,680)	227,110
- R - SEK	190,716	3,367	–	(24,154)	169,929
- R - USD	187,767	9,446	–	(25,363)	171,850
- R - USD (AIDiv)	89,419	–	–	(3,910)	85,509
- S - CHF	41,142	31,245	–	(5,384)	67,003
- S - CHF (AIDiv)	89,217	14,725	–	(22,098)	81,844
- S - EUR	1,084,930	775,053	–	(270,396)	1,589,587
- S - EUR (AIDiv)	258,397	39,571	–	(17,166)	280,802
- S - GBP	1,973	14,963	–	(2,330)	14,606
- S - GBP (AIDiv)	12,460	7,067	–	–	19,527
- S - USD	17,186	35,613	–	(296)	52,503
- S - USD (AIDiv)	1,803	15,209	–	–	17,012
- Y - EUR	1,532,369	31,193	–	(95,540)	1,468,022

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben (Fortsetzung)

In Umlauf befindliche Aktien (Fortsetzung)

Teilfonds	In Umlauf befindliche Aktien zu Beginn des			In Umlauf befindliche Aktien am Ende des	
	Geschäftsjahrs/ Berichtszeitraums	Gezeichnete Aktien	Reinvestierte Aktien	Zurückgenommene Aktien	Geschäftsjahrs/ Berichtszeitraums
BlueBay Funds – BlueBay					
Emerging Market Local					
Currency Bond Fund					
- B - EUR	3,668	–	–	(1,468)	2,200
- B - USD	2,985	–	–	–	2,985
- C - EUR	4,731	2,822	–	(247)	7,306
- C - GBP (AIDiv)	324	–	–	(55)	269
- C - USD	11,523	–	–	(3,635)	7,888
- C - USD (AIDiv)	2,349	–	–	–	2,349
- D - GBP (QIDiv)	1,182	–	–	–	1,182
- DR - GBP (QIDiv)	1,111	–	–	–	1,111
- G - USD	24,450	287	–	(9,642)	15,095
- M - EUR	40,103	–	–	(4,682)	35,421
- Q - CHF	10	–	–	–	10
- Q - EUR	650	–	–	–	650
- R - CHF	400	–	–	–	400
- R - EUR	9,877	–	–	–	9,877
- R - EUR (AIDiv)	920	–	–	–	920
- R - SEK	150,387	24,431	–	(18,766)	156,052
- R - USD	23,749	–	–	(6,752)	16,997
- R - USD (AIDiv)	10,143	–	–	–	10,143
- S - GBP (AIDiv)	1,576	–	–	–	1,576
- S - USD	1,094	–	–	–	1,094
BlueBay Funds – BlueBay					
Emerging Market Select Bond					
Fund					
- B - EUR	12,568	12	–	–	12,580
- B - USD	146	–	–	–	146
- C - EUR	806	72	–	(37)	841
- I - EUR	469,501	351	–	–	469,852
- M - EUR	131,266	34,727	–	(21,719)	144,274
- R - EUR	9,262	–	–	(1,039)	8,223
- R - NOK	2,284	–	–	–	2,284
- R - SEK	1,949	65	–	(58)	1,956
- R - USD	2,040	16,028	–	(453)	17,615
BlueBay Funds – BlueBay					
Emerging Market Corporate					
Bond Fund					
- B - CHF	2,770	–	–	–	2,770
- B - EUR	3,940	–	–	(930)	3,010
- B - USD	132,153	–	–	(2,025)	130,128
- C - EUR	413	–	–	–	413
- C - EUR (AIDiv)	2,685	–	–	–	2,685
- C - GBP (AIDiv)	2,568	–	–	(1,002)	1,566
- C - USD	11,441	–	–	(3,435)	8,006
- C - USD (AIDiv)	6,059	1,180	–	–	7,239
- DR - GBP (QIDiv)	7,565	–	–	(980)	6,585
- I - EUR	16,486	–	–	(14,000)	2,486
- I - EUR (Perf)	338,701	–	–	(2,483)	336,218
- I - USD	211,823	426	–	–	212,249
- I - USD (Perf)	1,986	–	–	(1,264)	722
- M - EUR	254	–	–	–	254
- Q - EUR (AIDiv)	118	–	–	–	118
- Q - USD	3,217	–	–	–	3,217
- R - CHF	1,938	–	–	–	1,938
- R - EUR	58,295	–	–	(5,495)	52,800
- R - EUR (AIDiv)	42,401	–	–	(3,959)	38,442
- R - NOK	2,356	–	–	–	2,356
- R - SGD (MIDiv)	4,761	–	–	–	4,761
- R - USD	107,452	99	–	(5,981)	101,570
- R - USD (AIDiv)	115,859	–	1,049	(5,442)	111,466
- S - CHF	1,954	–	–	(978)	976
- S - EUR	14,354	–	–	(1,380)	12,974
- S - EUR (AIDiv)	9,824	–	–	(7,592)	2,232
- S - GBP (AIDiv)	445	–	–	–	445

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben (Fortsetzung)

In Umlauf befindliche Aktien (Fortsetzung)

Teilfonds	In Umlauf befindliche Aktien zu Beginn des			In Umlauf befindliche Aktien am Ende des	
	Geschäftsjahrs/ Berichtszeitraums	Gezeichnete Aktien	Reinvestierte Aktien	Zurückgenommene Aktien	Geschäftsjahrs/ Berichtszeitraums
BlueBay Funds – BlueBay					
Emerging Market Corporate Bond Fund (Fortsetzung)					
- S - NOK	1,982	–	–	(1,500)	482
- S - USD	24,205	–	–	(11,216)	12,989
- S - USD (AIDiv)	14,777	–	–	(7,331)	7,446
- X - GBP	1,488	–	–	–	1,488
- X - USD	955	–	–	–	955
BlueBay Funds – BlueBay					
Global Convertible Bond Fund					
- B - EUR	145	–	–	–	145
- B - GBP	979	–	–	(196)	783
- B - GBP (BHedged)	384,663	16	–	(384,679)	–
- B - USD	15,054	–	–	(970)	14,084
- B - USD (Perf)-(BHedged)	139,498	67	–	(128,547)	11,018
- D - GBP (QIDiv)	1,331	–	–	(958)	373
- DR - GBP (QIDiv)	757	–	–	–	757
- I - USD	238	–	–	–	238
- I - USD (Perf)	238,699	–	–	(238,699)	–
- R - CHF	1,835	–	–	–	1,835
- R - EUR	3,972	–	–	(390)	3,582
- R - EUR (AIDiv)	1,830	–	–	(610)	1,220
- R - USD	24,320	21	–	(1,752)	22,589
- R - USD (AIDiv)	1,077	–	17	–	1,094
- S - CHF (BHedged)	8,019	–	–	–	8,019
- S - USD	2,727	–	–	–	2,727
- X - EUR	930	–	–	–	930
- X - GBP	3,293	–	–	–	3,293
- X - USD	3,252	–	–	(468)	2,784
BlueBay Funds – BlueBay					
Emerging Market Unconstrained Bond Fund					
- C - EUR (QIDiv)	1,306	–	2	(115)	1,193
- C - GBP	61,890	2,826	–	(21,183)	43,533
- C - USD	14,641	32,981	–	(1,131)	46,491
- C - USD (QIDiv)	3,770	–	–	(3,002)	768
- ER - SEK	8,090	5,284	–	(5,505)	7,869
- G - EUR (Perf)	1,365,461	–	–	–	1,365,461
- I - EUR	1,110,561	21,799	–	(334,912)	797,448
- I - USD	25,316	1,052	–	(16,499)	9,869
- K - EUR	219,580	–	–	(67,000)	152,580
- M - EUR	416,050	9,087	–	(94,406)	330,731
- M - USD	63,224	2,847	–	(6,846)	59,225
- Q - EUR	70,943	15,877	–	(18,402)	68,418
- Q - GBP	–	93	–	–	93
- Q - GBP (QIDiv)	–	94	–	–	94
- Q - USD	236,335	–	–	(236,335)	–
- R - CHF	–	108	–	–	108
- R - EUR	–	112	–	–	112
- R - USD	–	107	–	–	107
- S - CAD (QIDiv)	6,089	805	193	–	7,087
- S - EUR	23,455	195,234	–	(2,655)	216,034
- S - GBP	233,893	68,697	–	(29,185)	273,405
- S - GBP (QIDiv)	26,738	17,479	–	(1,147)	43,070
- S - USD	154,304	45,613	–	(6,851)	193,066
- X - EUR	1,639	–	–	–	1,639
- X - GBP	6,972	–	–	–	6,972
- X - USD	1,886	–	–	–	1,886

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben (Fortsetzung)

In Umlauf befindliche Aktien (Fortsetzung)

Teilfonds	In Umlauf befindliche Aktien zu Beginn des			In Umlauf befindliche Aktien am Ende des	
	Geschäftsjahrs/ Berichtszeitraums	Gezeichnete Aktien	Reinvestierte Aktien	Zurückgenommene Aktien	Geschäftsjahrs/ Berichtszeitraums
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund					
- B - EUR	36,979	6,956	–	(2,053)	41,882
- B - USD	138,113	276	–	(9,758)	128,631
- C - EUR	3,081,009	1,857,584	–	(878,051)	4,060,542
- I - EUR	6,043,317	901,416	–	(560,650)	6,384,083
- I - EUR (AIDiv)	801,902	101,781	–	–	903,683
- I - USD	766	–	–	–	766
- K - EUR	1,701,763	2,240,467	–	(239,841)	3,702,389
- M - EUR	444,623	212,427	–	(101,314)	555,736
- M - USD	524	–	–	–	524
- Q - CHF	685,223	101,863	–	(115,576)	671,510
- Q - EUR	8,088,936	1,373,740	–	(896,403)	8,566,273
- Q - EUR (AIDiv)	528,335	41,533	–	(46,298)	523,570
- Q - USD	6,484	4,691	–	(1,829)	9,346
- R - CHF	50	200	–	–	250
- R - EUR	143,248	193,452	–	(57,777)	278,923
- R - EUR (AIDiv)	6,034	96	2	(2,223)	3,909
- R - GBP	1,845	–	–	–	1,845
- R - USD	10,589	–	–	–	10,589
- S - EUR	4,337,081	585,180	–	(590,650)	4,331,611
- S - EUR (QIDiv)	2,487	304	–	(811)	1,980
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund					
- B - CHF	4,378	–	–	(597)	3,781
- B - EUR	36,835	9,118	–	(4,159)	41,794
- B - USD	2,654	–	–	–	2,654
- C - EUR	1,867,560	682,225	–	(360,242)	2,189,543
- C - EUR (AIDiv)	60,341	2,948	–	(6,119)	57,170
- I - EUR	7,153,711	931,663	–	(578,796)	7,506,578
- I - EUR (AIDiv)	762,393	77,465	–	(271,349)	568,509
- I - EUR (QIDiv)	2,211,239	–	–	(167,218)	2,044,021
- I - USD	230,282	97,860	–	–	328,142
- M - EUR	518,188	172,567	–	(99,431)	591,324
- M - USD	691	–	–	–	691
- Q - CHF	34,538	21	–	(5,433)	29,126
- Q - EUR	1,147,212	167,039	–	(303,506)	1,010,745
- Q - EUR (AIDiv)	27,639	–	–	(1,657)	25,982
- R - EUR	562,435	108,228	–	(290,464)	380,199
- R - EUR (AIDiv)	32,061	4,052	–	(2,922)	33,191
- R - NOK	14,261	–	–	–	14,261
- R - USD	1,345	448	–	–	1,793
- S - EUR	836,399	61,833	–	(151,197)	747,035
- S - EUR (QIDiv)	312,447	132,589	–	(29,134)	415,902
- S - JPY	3,151,475	–	–	(54,840)	3,096,635
BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund					
- B - CHF	7,895	–	–	–	7,895
- B - EUR	42,301	159	–	(6,192)	36,268
- B - EUR (AIDiv)	11,955	400	–	(2,855)	9,500
- B - GBP	28,842	2,850	–	–	31,692
- B - USD	804,393	25,468	–	(96,527)	733,334
- B - USD (AIDiv)	650,323	89,127	–	(18,915)	720,535
- C - CHF	3,767	–	–	(384)	3,383
- C - EUR	46,315	56,276	–	(12,745)	89,846
- C - EUR (AIDiv)	152,994	18,395	127	(8,587)	162,929
- C - GBP	19	–	–	–	19
- C - GBP (AIDiv)	71,861	5,719	–	(38,281)	39,299
- C - USD	85,862	3,057	–	(26,477)	62,442
- C - USD (AIDiv)	163,795	1,043	87	(4,130)	160,795
- D - GBP (QIDiv)	1,000	–	–	–	1,000
- I - EUR	1,648,244	44,559	–	(375,946)	1,316,857
- I - EUR (AIDiv)	261,529	107,959	–	(18,579)	350,909

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben (Fortsetzung)

In Umlauf befindliche Aktien (Fortsetzung)

Teilfonds	In Umlauf befindliche Aktien zu Beginn des			In Umlauf befindliche Aktien am Ende des	
	Geschäftsjahrs/ Berichtszeitraums	Gezeichnete Aktien	Reinvestierte Aktien	Zurückgenommene Aktien	Geschäftsjahrs/ Berichtszeitraums
BlueBay Funds – BlueBay					
Global High Yield Bond Fund					
(Fortsetzung)					
- I - EUR (Perf)	1,376,827	1,720	–	–	1,378,547
- I - GBP	336,042	531	–	–	336,573
- I - NOK	147,745	83,505	–	(54,690)	176,560
- I - SEK	55,157	41	–	–	55,198
- I - USD	1,166,375	76,889	–	(720,171)	523,093
- M - EUR	1,992	20	–	(535)	1,477
- Q - CHF	163,441	2,346	–	(952)	164,835
- Q - EUR	9,370	–	–	(150)	9,220
- Q - EUR (AIDiv)	225,068	–	–	(68)	225,000
- Q - GBP (QIDiv)	62,108	324	–	(6,346)	56,086
- Q - SEK	133	–	–	(133)	–
- Q - USD	412,112	86,274	–	(136,610)	361,776
- Q - USD (QIDiv)	26,004	2,170	–	(50)	28,124
- R - CHF	296,983	8,171	–	(1,798)	303,356
- R - EUR	8,383	1,533	–	(5,548)	4,368
- R - NOK	4,093	–	–	–	4,093
- R - USD	12,651	1,150	–	(4,673)	9,128
- S - EUR	1,179,643	215,568	–	(118,147)	1,277,064
- S - GBP	165,907	33,210	–	(18,684)	180,433
- S - GBP (AIDiv)	1,023,211	151,111	–	(52,925)	1,121,397
- S - USD	530,385	90,359	–	(69,649)	551,095
- S - USD (QIDiv)	1,010,934	153,054	–	(29,191)	1,134,797
- X - EUR	232	–	–	–	232
- X - GBP	1,538	–	–	–	1,538
- X - USD	3,813	–	–	–	3,813
BlueBay Funds – BlueBay					
Emerging Market Investment					
Grade Corporate Bond Fund					
- B - EUR	3,210	–	–	(625)	2,585
- I - EUR (AIDiv)	1,437,402	–	–	–	1,437,402
- R - EUR	939	–	–	(667)	272
BlueBay Funds – BlueBay					
Investment Grade Absolute					
Return Bond Fund					
- B - CHF	4,771	500	–	–	5,271
- B - EUR	14,714	–	–	–	14,714
- B - EUR (AIDiv)	3,249	–	–	–	3,249
- B - EUR (Perf)	4,761	–	–	–	4,761
- B - GBP	950	–	–	–	950
- B - USD	20,949	1,801	–	–	22,750
- C - EUR	4,587	2,894	–	(142)	7,339
- C - GBP	28,273	–	–	–	28,273
- C - GBP (AIDiv)	4,058	–	–	–	4,058
- C - USD	21,748	12	–	(312)	21,448
- C - USD (AIDiv)	3,356	–	–	–	3,356
- D - GBP (QIDiv)	4,116	–	–	–	4,116
- I - CHF	31,923	10,982	–	(2,321)	40,584
- I - EUR	662,294	76,607	–	(153,545)	585,356
- I - EUR (AIDiv)	1,169,186	–	17,559	(358,000)	828,745
- I - EUR (Perf)	236	–	–	–	236
- I - NOK	10,138	242	–	(7,752)	2,628
- I - USD	424,469	3,176	–	(108,549)	319,096
- I - USD (AIDiv)	4,764	–	–	–	4,764
- K - EUR (QKDiv)	1,064,312	–	–	–	1,064,312
- M - CHF	98	–	–	(98)	–
- M - EUR	479,521	31,566	–	(184,626)	326,461
- M - USD	20,975	2,618	–	(6,471)	17,122
- Q - CHF	103	–	–	–	103
- Q - EUR	107,950	9,158	–	(84,450)	32,658

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben (Fortsetzung)

In Umlauf befindliche Aktien (Fortsetzung)

Teilfonds	In Umlauf befindliche Aktien zu Beginn des				In Umlauf befindliche Aktien am Ende des
	Geschäftsjahrs/ Berichtszeitraums	Gezeichnete Aktien	Reinvestierte Aktien	Zurückgenommene Aktien	
BlueBay Funds – BlueBay					
Investment Grade Absolute					
Return Bond Fund (Fortsetzung)					
- Q - EUR (AIDiv)	92	–	2	–	94
- Q - GBP (AIDiv)	94	–	3	–	97
- Q - USD	2,370	–	–	(2,370)	–
- R - EUR	20,037	2,241	–	(6,911)	15,367
- R - EUR (AIDiv)	3,464	–	–	(171)	3,293
- R - USD	32,994	1,198	–	(479)	33,713
- R - USD (AIDiv)	1,627	–	–	–	1,627
- S - CHF	5,154	1,863	–	(3,853)	3,164
- S - CHF (AIDiv)	103	150	2	–	255
- S - EUR	720,555	36,115	–	(196,225)	560,445
- S - GBP	6,655	–	–	(6,602)	53
- S - GBP (AIDiv)	92	–	3	–	95
- S - JPY	3,286,562	334,035	–	(458,581)	3,162,016
- S - USD	186,176	1,151	–	(79,066)	108,261
- X - GBP	967	–	–	–	967
- X - USD	338	–	–	–	338
- Y - EUR	1,212,127	165,564	–	(82,229)	1,295,462
BlueBay Funds – BlueBay					
Emerging Market High Yield					
Corporate Bond Fund					
- C - EUR	14,500	–	–	(3,700)	10,800
- I - EUR	581,346	–	–	(101,181)	480,165
- I - NOK	6,941	81	–	(2,994)	4,028
- I - USD	–	100,000	–	–	100,000
- I - USD (Perf)	1,600	–	–	(1,600)	–
- R - USD (AIDiv)	11,208	48	888	–	12,144
BlueBay Funds – BlueBay					
Global Investment Grade					
Corporate Bond Fund					
- B - EUR	10,737	20,718	–	(450)	31,005
- B - USD	93,696	22,881	–	(5,598)	110,979
- C - EUR	21,837	73,605	–	(4,378)	91,064
- C - EUR (AIDiv)	4,528	5,831	–	(900)	9,459
- C - GBP	–	88	–	–	88
- C - USD	156,824	17,670	–	(49,871)	124,623
- C - USD (AIDiv)	47,040	10,507	–	(2,754)	54,793
- I - EUR	2,424,299	51,862	–	(1,781,840)	694,321
- I - EUR (AIDiv)	261,801	–	–	–	261,801
- I - GBP	–	1,873,899	–	–	1,873,899
- I - USD	4,814,094	2,337,762	–	(1,621,003)	5,530,853
- I - USD (MIDiv)	79,587	57,503	–	–	137,090
- M - CHF	98,429	9,471	–	(12,516)	95,384
- M - EUR	37,577	9,262	–	(3,532)	43,307
- M - USD	19,026	37,605	–	(2,528)	54,103
- Q - CHF (QIDiv)	27,767	17,760	–	(233)	45,294
- Q - EUR	157,576	17,901	–	(3,509)	171,968
- Q - EUR (AIDiv)	251,643	8,408	–	–	260,051
- Q - GBP	19,730	500	–	(1,640)	18,590
- Q - GBP (QIDiv)	1,988,037	109,943	–	(33,012)	2,064,968
- Q - USD	857,473	196,150	–	(7,579)	1,046,044
- Q - USD (QIDiv)	328,976	100,935	–	(31,868)	398,043
- R - CHF	375	–	–	–	375
- R - CHF (AIDiv)	107	–	5	–	112
- R - CHF (QIDiv)	109	130	1	(110)	130
- R - EUR	18,012	5,395	–	(6,458)	16,949
- R - EUR (QIDiv)	108	180	3	–	291
- R - GBP	78	–	–	–	78
- R - GBP (QIDiv)	80	–	2	–	82
- R - USD	55,867	92,405	–	(7,798)	140,474
- R - USD (QIDiv)	–	2,825	–	–	2,825
- S - AUD (QIDiv)	276,191	19,411	–	(82,990)	212,612
- S - CHF	1,810	13,154	–	–	14,964

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben (Fortsetzung)

In Umlauf befindliche Aktien (Fortsetzung)

Teilfonds	In Umlauf befindliche Aktien zu Beginn des				In Umlauf befindliche Aktien am Ende des
	Geschäftsjahrs/ Berichtszeitraums	Gezeichnete Aktien	Reinvestierte Aktien	Zurückgenommene Aktien	
BlueBay Funds – BlueBay Global					
Investment Grade Corporate					
Bond Fund (Fortsetzung)					
- S - EUR	14,745	43,627	–	(4,739)	53,633
- S - EUR (QIDiv)	17,407	2,740	48	(1,189)	19,006
- S - GBP	215,469	–	–	(212,717)	2,752
- S - GBP (QIDiv)	2,766,729	537,167	–	(958,163)	2,345,733
- S - JPY	659,433	89,382	–	(114)	748,701
- S - USD	43,282	33,100	–	(1,492)	74,890
- S - USD (QIDiv)	35,748	2,743	–	(10,949)	27,542
- X - EUR	1,106	–	–	–	1,106
- X - GBP	654	–	–	–	654
- X - USD	255	–	–	–	255
- Y - CAD	128,895	–	–	–	128,895
- Y - GBP	–	78	–	–	78
- Y - GBP (MIDiv)	–	149,479	–	(8,222)	141,257
BlueBay Funds – BlueBay Total					
Return Credit Fund					
- B - USD	3,250	–	–	–	3,250
- C - EUR	4,743	–	–	–	4,743
- C - EUR (QIDiv)	7,643	–	–	(7,643)	–
- C - GBP (QIDiv)	8,891	12,587	71	–	21,549
- C - USD	107,509	6,271	–	(1,510)	112,270
- C - USD (QIDiv)	44,229	–	21	(20,277)	23,973
- I - AUD	480,811	481	–	(103,068)	378,224
- I - EUR	75,765	8,162	–	–	83,927
- I - GBP	2,787,279	2,425	–	(545,875)	2,243,829
- I - GBP (QIDiv)	1,155,745	1,621	–	(88,122)	1,069,244
- I - NOK	489	–	–	(24)	465
- I - USD	88,905	20,400	–	–	109,305
- M - EUR	91,388	–	–	(91,388)	–
- M - NOK	4,432	–	–	(866)	3,566
- S - JPY	298,483	–	–	(100)	298,383
BlueBay Funds – BlueBay					
Financial Capital Bond Fund					
- B - USD	34,983	–	–	(4,711)	30,272
- C - CHF (AIDiv)	111,150	2,161	–	(32,314)	80,997
- C - EUR	122,309	3,336	–	(28,534)	97,111
- C - EUR (AIDiv)	49,504	1,539	–	(9,121)	41,922
- C - GBP	17,483	11,918	–	(2,942)	26,459
- C - GBP (AIDiv)	806,221	134,299	–	(205,311)	735,209
- C - USD	65,395	7,361	–	(26,978)	45,778
- C - USD (AIDiv)	150,216	15,042	147	(27,586)	137,819
- G - EUR (AIDiv)	40,815	3,299	–	(4,310)	39,804
- G - GBP	282,492	7,827	–	(44,237)	246,082
- G - GBP (AIDiv)	66,783	15,547	–	(11,944)	70,386
- G - USD (AIDiv)	240,458	10,804	377	(8,297)	243,342
- I - EUR	3,659,108	265,150	–	(266,346)	3,657,912
- I - GBP (AIDiv)	289,239	380	–	–	289,619
- I - NOK	27,435	–	–	–	27,435
- I - SEK	289,752	5,558	–	(93,547)	201,763
- I - USD	3,654,105	75,320	–	(738,592)	2,990,833
- K - CHF	3,300	–	–	(3,300)	–
- K - EUR	187,112	925	–	(1,859)	186,178
- K - GBP	279,490	23,184	–	(51,806)	250,868
- K - GBP (AIDiv)	1,151,144	39,236	41,359	(127,448)	1,104,291
- K - USD	12,920	1,070	–	–	13,990
- K - USD (AIDiv)	15,000	–	–	–	15,000
- M - CHF	23,556	925	–	(1,535)	22,946
- M - EUR	128,962	7,149	–	(23,419)	112,692
- M - EUR (AIDiv)	850	1,983	–	–	2,833
- M - GBP	6,640	3,205	–	–	9,845
- M - USD	134,470	39,622	–	(6,823)	167,269
- M - USD (AIDiv)	38,663	–	–	(250)	38,413

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben (Fortsetzung)

In Umlauf befindliche Aktien (Fortsetzung)

Teilfonds	In Umlauf befindliche Aktien zu Beginn des				In Umlauf befindliche Aktien am Ende des
	Geschäftsjahrs/ Berichtszeitraums	Gezeichnete Aktien	Reinvestierte Aktien	Zurückgenommene Aktien	Geschäftsjahrs/ Berichtszeitraums
BlueBay Funds – BlueBay Financial Capital Bond Fund (Fortsetzung)					
- Q - CHF	29,459	832	–	(4,310)	25,981
- Q - EUR	188,616	29,279	–	(43,319)	174,576
- Q - SEK	5,934	–	–	–	5,934
- Q - USD	176,298	34,671	–	(39,755)	171,214
- Q - USD (AIDiv)	9,762	205	–	–	9,967
- R - EUR	14,390	–	–	(95)	14,295
- R - EUR (AIDiv)	2,165	–	118	–	2,283
- R - SEK	16,187	–	–	(8,615)	7,572
- R - USD	21,173	14,957	–	(660)	35,470
- R - USD (AIDiv)	4,568	957	–	(1,568)	3,957
- S - EUR	495,292	7,651	–	(44,347)	458,596
- S - EUR (AIDiv)	28,071	48,193	–	–	76,264
- S - GBP	136,688	–	–	(5,476)	131,212
- S - USD	3,000	3,470	–	–	6,470
- X - EUR	13,125	–	–	–	13,125
- X - GBP	18,050	–	–	–	18,050
- X - USD	14,635	–	–	(1,462)	13,173
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund					
- C - USD (BHedged)	160,588	155,627	–	(304,563)	11,652
- I - EUR (BHedged)	535,265	50,151	–	(31,103)	554,313
- I - NOK (BHedged)	4,501,365	1,605,814	–	(52,894)	6,054,285
- I - USD (BHedged)	189,735	75,854	–	(2,100)	263,489
- M - EUR (AIDiv)-(BHedged)	4,320	5,451	–	(763)	9,008
- M - EUR (BHedged)	2,982	3,005	–	(230)	5,757
- M - NOK (BHedged)	20,115	1	–	(5,381)	14,735
- Q - EUR	–	604,344	–	–	604,344
- Q - JPY (BHedged)	3,566,232	83,950	–	(440)	3,649,742
- R - USD	3,748	–	–	–	3,748
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund					
- B - USD	2,399	216	–	(643)	1,972
- I - AUD	370,553	835	–	–	371,388
- I - USD	1,180,909	98,753	–	(54,100)	1,225,562
- K - GBP	–	319,692	–	(68,846)	250,846
- K - GBP (MIDiv)	–	882,053	1	(102,262)	779,792
- M - EUR	220,800	1,772	–	(69,505)	153,067
- Q - EUR (QIDiv)	29,855	2,395	–	–	32,250
- R - USD	215	–	–	–	215
- S - EUR	18,207	–	–	–	18,207
- S - JPY	1,735,853	–	–	(817)	1,735,036
- S - USD	265,746	151,627	–	(31,506)	385,867
- Y - CAD	612,844	271,838	–	–	884,682
BlueBay Funds – BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund					
- A - USD (CPerf)	124	–	–	–	124
- C - EUR (CPerf)	40,991	18,337	–	(370)	58,958
- C - EUR (CPerf)-(QIDiv)	1,719	314	–	–	2,033
- C - GBP (CPerf)	29,882	231	–	(4,928)	25,185
- C - USD (CPerf)	12,681	58,860	–	(19,736)	51,805
- I - CAD (ACDiv)	359,603	511	53,218	(27,431)	385,901
- I - EUR	781,337	52,309	–	(82,162)	751,484
- I - EUR (CPerf)	74,026	30,977	–	(20,127)	84,876
- I - EUR (Perf)	368,555	26,801	–	(54,010)	341,346
- I - GBP (Perf)	53,897	72	–	–	53,969
- I - JPY (Perf)	–	100,000	–	–	100,000
- I - USD	35,554	120	–	(200)	35,474
- I - USD (Perf)	180,377	239,040	–	(61,565)	357,852
- M - EUR	88,450	54,015	–	(45,509)	96,956

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben (Fortsetzung)

In Umlauf befindliche Aktien (Fortsetzung)

Teilfonds	In Umlauf befindliche Aktien zu Beginn des				In Umlauf befindliche Aktien am Ende des
	Geschäftsjahrs/ Berichtszeitraums	Gezeichnete Aktien	Reinvestierte Aktien	Zurückgenommene Aktien	
BlueBay Funds – BlueBay					
Global Sovereign Opportunities					
Fund (Fortsetzung)					
- M - EUR (CPerf)	209,236	19,292	–	(86,844)	141,684
- M - USD (CPerf)	152	–	–	–	152
- Q - EUR (CPerf)	278,809	109,747	–	(45,592)	342,964
- Q - NOK (CPerf)	56,399	1,633	–	(12,302)	45,730
- Q - SEK (CPerf)	963,000	46,039	–	(136,157)	872,882
- S - USD (CPerf)	1,000	–	–	(1,000)	–
- ZR - EUR (CPerf)	128,854	–	–	–	128,854
- ZR - GBP (CPerf)-(AIDiv)	73,008	5,484	–	(11,018)	67,474
- ZR - USD (CPerf)-(AIDiv)	9,917	134	–	(5,891)	4,160
BlueBay Funds – BlueBay					
Global High Yield ESG Bond					
Fund					
- B - USD	69,151	37,651	–	(37,848)	68,954
- C - EUR	5,553	720	–	(2,345)	3,928
- C - GBP	196	321	–	(61)	456
- C - GBP (AIDiv)	59,828	28,938	–	(65,287)	23,479
- I - EUR	2,072,220	2,953	–	(1,969,858)	105,315
- I - NOK	1,783,296	584,270	–	(44,442)	2,323,124
- I - USD	80,764	16,230	–	(10,134)	86,860
- K - EUR (AIDiv)	32,965	–	2,056	–	35,021
- K - USD (AIDiv)	49,409	–	3,450	–	52,859
- M - USD	1,261	–	–	(136)	1,125
- Q - EUR	2,236	–	–	(311)	1,925
- R - EUR	17,302	–	–	(1,836)	15,466
- R - USD (AIDiv)	84,956	10,844	–	(4,622)	91,178
- S - EUR	436,880	82,987	–	(67,855)	452,012
- S - EUR (QIDiv)	20,361	3,494	–	(1,974)	21,881
- S - GBP	61,392	5,844	–	(18,722)	48,514
- S - GBP (QIDiv)	437,310	101,526	–	(32,784)	506,052
- S - USD	145,659	9,130	–	(13,471)	141,318
- S - USD (QIDiv)	150,291	11,824	–	(7,826)	154,289
BlueBay Funds – BlueBay					
Investment Grade Structured					
Credit Fund					
- G - EUR	5,819	–	–	–	5,819
- G - GBP	5,391	–	–	(1,835)	3,556
- G - GBP (QIDiv)	1,290	–	38	–	1,328
- G - USD	1,574	–	–	–	1,574
- G - USD (QIDiv)	522	–	–	–	522
- I - EUR (AIDiv)	353,434	112,376	–	(99,500)	366,310
- I - USD	120,689	340,750	–	–	461,439
- K - EUR	669,754	–	–	(3,224)	666,530
- M - EUR	501	5,189	–	(498)	5,192
- Q - EUR	41,590	925	–	(4,656)	37,859
- Q - GBP	8,415	2,278	–	(170)	10,523
- Q - USD	436,230	–	–	(453)	435,777
- S - EUR	237,386	–	–	–	237,386
- S - GBP	20,958	1,317	–	(2,156)	20,119
- S - USD	338,802	5,351	–	(12,858)	331,295
BlueBay Funds – BlueBay					
Emerging Market Aggregate					
Short Duration Bond Fund					
- G - EUR	4,446	–	–	(2,260)	2,186
- G - GBP	10	–	–	–	10
- G - GBP (AIDiv)	57,080	–	–	(4,295)	52,785
- G - USD	60,357	9,122	–	(14,057)	55,422
- G - USD (MIDiv)	7,953	–	1	(398)	7,556
- I - USD	11	–	–	–	11
- K - EUR	142,087	161,024	–	(52,972)	250,139
- K - USD	94	114	–	–	208
- M - EUR	79,276	36,460	–	(16,982)	98,754
- R - EUR	–	1,261	–	(1,261)	–

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Statistische Angaben (Fortsetzung)

In Umlauf befindliche Aktien (Fortsetzung)

Teilfonds	In Umlauf befindliche Aktien zu Beginn des Geschäftsjahrs/ Berichtszeitraums	Gezeichnete Aktien	Reinvestierte Aktien	Zurückgenommene Aktien	In Umlauf befindliche Aktien am Ende des Geschäftsjahrs/ Berichtszeitraums
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund (Fortsetzung)					
- S - JPY	120,963	–	–	–	120,963
- W - USD	16,107	14,638	–	(4,011)	26,734
BlueBay Funds – BlueBay High Grade Structured Credit Short Duration Fund					
- G - EUR	–	95,708	–	–	95,708
- I - EUR	153,552	38,795	–	–	192,347
- K - EUR	860,386	22,901	–	(980)	882,307
- K - USD	–	137,155	–	–	137,155
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade ESG Bond Fund					
- I - EUR	95,673	9,751	–	(1,100)	104,324
- S - EUR	127,114	2,227	–	(2,199)	127,142
BlueBay Funds – BlueBay Impact – Aligned Bond Fund					
- C - GBP	76,146	53,103	–	(23,901)	105,348
- C - GBP (QIDiv)	120	–	2	–	122
- G - EUR	3,217	27	–	(824)	2,420
- G - EUR (QIDiv)	2,815	643	–	(1,134)	2,324
- G - GBP	355,626	168,255	–	(24,447)	499,434
- G - GBP (QIDiv)	72,161	16,236	–	(15,169)	73,228
- G - USD	32,654	243	–	(88)	32,809
- I - USD	200,000	–	–	(3,055)	196,945
- K - CHF	18,988	7,746	–	(1,320)	25,414
- K - EUR	9,654	1,400	–	–	11,054
- K - GBP	–	264,980	–	(4,771)	260,209
- K - USD	145,594	90,626	–	(22,061)	214,159
- R - CHF	129	–	–	–	129
- S - GBP	–	94	–	–	94
- S - GBP (QIDiv)	–	94	–	–	94
- X - GBP	5,383	–	–	–	5,383
- X - USD	973	–	–	–	973
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Government Bond Fund					
- I - EUR	525,000	389,515	–	(18,634)	895,881
- Q - GBP	–	93	–	–	93
- Q - GBP (QIDiv)	–	94	–	–	94
- S - CHF	–	104	–	–	104
- S - EUR	–	7,337	–	–	7,337
- S - EUR (AIDiv)	1,325	1,271	–	(426)	2,170
- S - GBP	–	758	–	–	758
- S - GBP (AIDiv)	898,880	225,527	–	(157,535)	966,872
- S - USD	–	21,093	–	–	21,093
- S - USD (AIDiv)	4,899	37,566	–	(908)	41,557
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Financials Plus Bond Fund					
- C - GBP	–	75	–	–	75
- C - GBP (QCDiv)	–	93	–	–	93
- I - USD	100,000	395,263	–	(100,000)	395,263
- S - GBP	–	94	–	–	94
- S - GBP (QIDiv)	–	94	–	–	94

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023

1 Allgemeine Informationen

BlueBay Funds (die „SICAV“) ist eine Anlagegesellschaft, die als Aktiengesellschaft entsprechend den Gesetzen des Großherzogtums Luxemburg gegründet wurde und die Kriterien einer „Société d'Investissement à Capital Variable“ („SICAV“) erfüllt. Die SICAV wurde am 3. Juli 2002 auf unbestimmte Zeit in Luxemburg gegründet und ist gemäß Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) (in der geänderten Fassung) (das „Gesetz von 2010“) zugelassen. Die SICAV hat BlueBay Funds Management Company S.A. (die „Verwaltungsgesellschaft“) gemäß Kapitel 15 des Gesetzes von 2010 zu ihrer Verwaltungsgesellschaft ernannt. Die SICAV erfüllt die Anforderungen an einen Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren gemäß Artikel 1, Absatz 2 (a) und (b) der Richtlinie 2009/65/EG.

Die SICAV bietet verschiedene Anlagemöglichkeiten, die zurzeit aus achtundzwanzig Teilfonds bestehen (jeweils der „Teilfonds“, zusammen die „Teilfonds“):

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund,
BlueBay Funds – BlueBay High Yield ESG Bond Fund,
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund,
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund,
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Select Bond Fund,
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund,
BlueBay Funds – BlueBay Global Convertible Bond Fund,
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund,
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund,
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund,
BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund,
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund,
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund,
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund,
BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund,
BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund,
BlueBay Funds – BlueBay Financial Capital Bond Fund,
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund,
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund,
BlueBay Funds – BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund,
BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund,
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Structured Credit Fund,
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund,
BlueBay Funds – BlueBay High Grade Structured Credit Short Duration Fund,
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade ESG Bond Fund,
BlueBay Funds – BlueBay Impact-Aligned Bond Fund,
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Government Bond Fund,
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Financials Plus Bond Fund.

Die Teilfonds unterscheiden sich hauptsächlich durch ihre spezifische Anlagepolitik und ihre spezifischen Anlageziele. Die SICAV bietet verschiedene Aktienklassen an. Detaillierte Informationen zu diesen Aktienklassen können dem Verkaufsprospekt der SICAV entnommen werden. Die Aktienklassen, die derzeit im Umlauf sind oder im Verlauf des Berichtszeitraums im Umlauf waren, sind in den Statistischen Angaben auf Seite 223 bis 249 aufgeführt.

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

2 Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze

Der Jahresbericht wurde in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen zur Erstellung und Darstellung von Abschlüssen sowie allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen für OGAW erstellt.

Im Folgenden finden Sie eine Zusammenfassung der wichtigsten Rechnungslegungsgrundsätze der SICAV:

a) Bewertung von Vermögenswerten

Der Wert von Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten sowie von sonstigen Vermögenswerten, die an einer Börse notiert sind oder gehandelt werden, wird auf der Grundlage des letzten verfügbaren Schlusskurses ermittelt. Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie sonstige Vermögenswerte, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden, werden in einer Weise bewertet, die so weit wie möglich jener Methode entspricht, die zur Bewertung börsennotierter Wertpapiere verwendet wird. Der Wert nicht börsennotierter Vermögenswerte oder Vermögenswerte, die nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden, sowie der Wert von Vermögenswerten, die an einem anderen Markt börsennotiert oder nicht börsennotiert sind und für die kein Bewertungskurs ermittelt werden kann, oder Vermögenswerte, für die die Börsennotierung den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, kann vom Verwaltungsrat der SICAV nach einer vorsichtigen Einschätzung und unter Anwendung der gebotenen Sorgfalt auf Grundlage der zu erwartenden Kauf- und Verkaufspreise ermittelt werden. Aktien oder Anteile von zugrunde liegenden offenen Organismen für gemeinsame Anlagen (die „OGA“) werden mit ihrem letzten ermittelten und verfügbaren Nettoinventarwert bewertet, oder es wird, falls ein solcher Preis nicht dem angemessenen Marktwert eines solchen Vermögenswerts entspricht, der Preis auf einer fairen und angemessenen Basis durch den Verwaltungsrat der SICAV ermittelt. Anteile oder Aktien geschlossener OGA werden zu ihrem letzten verfügbaren Wert am Aktienmarkt bewertet.

Der Marktwert, einschließlich nicht realisierter Wertanstiege/(-rückgänge) aus Anlagen, ist in der Nettovermögensaufstellung unter „Anlagen zum Marktwert“ ausgewiesen.

Liquide Mittel können zu ihrem Nennwert zuzüglich aufgelaufener Zinsen oder auf Grundlage ihres Restbuchwertes bewertet werden.

Der Verwaltungsrat der SICAV kann die Anwendung der Restbuchwertmethode (amortized cost method) zur Bewertung von kurzfristigen übertragbaren Schuldtiteln für bestimmte Teilfonds genehmigen. Diese Methode besteht darin, ein Wertpapier entsprechend seinen Kosten zu bewerten und anschließend eine konstante Abschreibung bis zur Fälligkeit sämtlicher Abschläge oder Aufschläge anzunehmen, unabhängig vom Einfluss der Zinsschwankungen auf den Marktwert des Wertpapiers oder sonstigen Instruments. Diese Methode bietet zwar Sicherheit bei der Bewertung, es kann dabei jedoch zu Geschäftsjahren kommen, in denen der durch die Bewertung zum Restbuchwert ermittelte Wert höher oder niedriger ist als der Preis, den der Teilfonds mit einem Verkauf der betreffenden Wertpapiere erzielen würde.

Einige der Wertpapiere des Teilfonds werden unter Verwendung der „Dirty Price“-Methode bewertet. Der notierte Kurs dieser Wertpapiere umfasst den gegenwärtigen Wert aller ihrer zukünftigen Cashflows, inklusive aller zum nächsten Couponzahlungstag anfallenden Zinsen. Alle auf diese Weise bewerteten Wertpapiere werden unter Wertpapierbestand und sonstiges Nettovermögen mit einem „Ω“ gekennzeichnet.

b) Devisenterminkontrakte

Offene Devisenterminkontrakte werden auf der Basis der Devisenterminsätze am entsprechenden Bewertungstag bewertet.

Als Liquidationswert von Devisenterminkontrakten, die nicht an einer Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt werden, gilt deren Nettoliquidationswert, der gemäß den Richtlinien des Verwaltungsrats der SICAV auf einer konsequent für Kontrakte dieser Art geltenden Grundlage ermittelt wird.

Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) aus Devisenterminkontrakten sind in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierte Wertanstiege aus Devisenterminkontrakten“ bzw. „Nicht realisierte Wertrückgänge aus Devisenterminkontrakten“ ausgewiesen.

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

2 Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

b) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) und die sich daraus ergebenden Nettoveränderungen der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens als „Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) aus Devisenterminkontrakten“ bzw. „Nettoveränderung der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) aus Devisenterminkontrakten“ ausgewiesen. Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) beinhalten Nettogewinne aus Verträgen, die abgeschlossen oder durch andere Verträge glattgestellt wurden. Die SICAV bietet ferner Absicherungen für die einzelnen Aktienklassen an. Alle Wertanstiege/(-rückgänge) aus der Absicherung einzelner Aktienklassen werden einzig der entsprechenden Aktienklasse zugeordnet.

c) Finanzterminkontrakte

Geht die SICAV einen Finanzterminkontrakt ein, muss sie bei ihrem entsprechenden Broker einen Geldbetrag hinterlegen, der der anfänglichen Einschusszahlung entspricht, die vom Broker oder der Börse festgelegt wurde. Finanzterminkontrakte werden auf Basis der täglichen Abwicklungskurse bewertet, die von der Börse festgelegt werden, an der sie gehandelt werden. Die SICAV und der Broker vereinbaren, einen Geldbetrag in Höhe der täglichen Schwankungen des Wertes des Finanzterminkontraktes auszutauschen (die „Änderungsmarge“).

Wertveränderungen offener Finanzterminkontrakte werden durch eine Marktpreisbewertung des Wertes des Kontrakts als nicht realisierte Wertanstiege oder -rückgänge zum Datum der Nettovermögensaufstellung verbucht. Wird der Kontrakt geschlossen, wird die Differenz zwischen den durch die Schlusstransaktion erzielten Einkünften (oder Kosten) und den Kosten der ursprünglichen Transaktion als realisierter Gewinn oder Verlust in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens aufgeführt.

Der Liquidationswert von Finanzterminkontrakten, die an einer Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt werden, wird auf Grundlage des letzten verfügbaren Abrechnungskurses dieser Kontrakte an der Börse und/oder dem geregelten Markt, an denen sie durch den Teilfonds gehandelt werden, ermittelt. Falls ein Finanzterminkontrakt nicht an dem Tag glattgestellt werden kann, auf den sich die Ermittlung des Nettovermögens bezieht, wird als Basis für die Ermittlung seines Liquidationswerts ein Wert zugrunde gelegt, den der Verwaltungsrat der SICAV für vernünftig und angemessen hält.

Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) aus Finanzterminkontrakten sind in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierte Wertanstiege aus Finanzterminkontrakten“ bzw. „Nicht realisierte Wertrückgänge aus Finanzterminkontrakten“ ausgewiesen.

Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) und die sich daraus ergebenden Nettoveränderungen der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens als „Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) aus Finanzterminkontrakten“ bzw. „Nettoveränderung der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) aus Finanzterminkontrakten“ ausgewiesen.

d) Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) aus dem Verkauf von Wertpapieren

Der realisierte Nettowertgewinn/(-verlust) aus dem Verkauf von Wertpapieren wird zu dem durchschnittlichen Anschaffungswert bewertet und in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens unter „Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Anlagen“ ausgewiesen.

e) Umrechnung von Fremdwährungen

Der Jahresbericht wurde in der Rechnungswährung des jeweiligen Teilfonds erstellt. Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf eine andere Währung als die Rechnungswährung des jeweiligen Teilfonds lauten, werden zu dem am Datum der Nettovermögensaufstellung geltenden Wechselkurs in die Rechnungswährung umgerechnet.

Die zusammengefasste Nettovermögensaufstellung und die Ertrags- und Aufwandsrechnung sowie die Veränderungen des Nettofondsvermögens der SICAV werden in Euro („EUR“) ausgewiesen, nachdem die entsprechenden Beträge aus der jeweiligen Rechnungswährung der einzelnen Teilfonds zu dem am Ende des Berichtszeitraums geltenden Wechselkurs umgerechnet wurden.

Eine Anpassung aus der Umrechnung von Fremdwährung in Höhe von EUR 111,029,484 ergibt sich aus der Umrechnung der Eröffnungsbilanz. Diese Umrechnungsmethode hat keinen Einfluss auf den Wert des Nettovermögens der einzelnen Teilfonds.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

2 Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

e) Umrechnung von Fremdwährungen (Fortsetzung)

Der Marktwert von Anlagen und anderen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, die auf eine andere Währung lauten als die Rechnungswährung der Teilfonds, wurden zu dem am 31. Dezember 2023 geltenden Wechselkurs umgerechnet. Die Kosten für Anlagen sowie Erträge und Aufwendungen, die auf eine andere Währung lauten als die Referenzwährung der Teilfonds, wurden zu den am Tag der Transaktion geltenden Wechselkursen umgerechnet.

Der Währungsgewinn oder -verlust aus der Umrechnung dieser Posten fließt in die Bestimmung des Betriebsergebnisses mit ein.

Die nachstehend aufgeführten Wechselkurse zum EUR wurden zugrunde gelegt, um die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der folgenden Teilfonds am Ende des Berichtszeitraums umzurechnen: BlueBay Funds – BlueBay High Yield ESG Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Structured Credit Fund, BlueBay Funds – BlueBay High Grade Structured Credit Short Duration Fund und BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade ESG Bond Fund:

Währung	Satz	Währung	Satz
Australischer Dollar (AUD)	1.6189	Neuseeland-Dollar (NZD)	1.7447
Brasilianischer Real (BRL)	5.3659	Norwegische Krone (NOK)	11.2185
Kanadischer Dollar (CAD)	1.4566	Polnischer Zloty (PLN)	4.3438
Chinesischer Yuan Renminbi (CNY)	7.8344	Omanischer Rial (OMR)	0.4253
Tschechische Krone (CZK)	24.6885	Russischer Rubel (RUB)	98.7558
Britisches Pfund (GBP)	0.8665	Singapur-Dollar (SGD)	1.4571
Ungarischer Forint (HUF)	382.2151	Südafrikanischer Rand (ZAR)	20.2013
Isländische Krone (ISK)	150.0888	Schwedische Krone (SEK)	11.1325
Indonesische Rupie (IDR)	17,008.2964	Schweizer Franken (CHF)	0.9297
Japanischer Yen (JPY)	155.7336	Thailändischer Baht (THB)	37.7045
Mexikanischer Peso (MXN)	18.7067	US-Dollar (USD)	1.1047

Die nachstehend aufgeführten Wechselkurse zum USD wurden zugrunde gelegt, um die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der folgenden Teilfonds am Ende des Berichtszeitraums umzurechnen: BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Select Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Global Convertible Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund, BlueBay Funds – BlueBay Financial Capital Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund, BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Impact-Aligned Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Government Bond Fund und BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Financials Plus Bond Fund:

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

2 Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

e) Umrechnung von Fremdwährungen (Fortsetzung)

Währung	Satz	Währung	Satz
Australischer Dollar (AUD)	1.4655	Neuer Taiwan-Dollar (TWD)	30.6905
Brasilianischer Real (BRL)	4.8576	Neuseeland-Dollar (NZD)	1.5794
Kanadischer Dollar (CAD)	1.3186	Nigerianischer Naira (NGN)	897.5000
Chilenischer Peso (CLP)	873.2850	Norwegische Krone (NOK)	10.1557
Chinesischer Yuan Renminbi (CNY)	7.0922	Peruanischer Nuevo Sol (PEN)	3.7026
Kolumbianischer Peso (COP)	3.874.0000	Polnischer Zloty (PLN)	3.9323
Tschechische Krone (CZK)	22.3496	Neuer Rumänischer Leu (RON)	4.5036
Dominikanischer Peso (DOP)	58.0600	Russischer Rubel (RUB)	89.4000
Euro (EUR)	0.9053	Saudi-Riyal (SAR)	3.7500
Britisches Pfund (GBP)	0.7844	Singapur-Dollar (SGD)	1.3191
Hongkong-Dollar (HKD)	7.8086	Südafrikanischer Rand (ZAR)	18.2875
Ungarischer Forint (HUF)	346.0056	Südkoreanischer Won (KRW)	1,287.9000
Isländische Krone (ISK)	135.8700	Schwedische Krone (SEK)	10.0779
Indische Rupie (INR)	83.2138	Schweizer Franken (CHF)	0.8417
Indonesische Rupie (IDR)	15,397.0000	Thailändischer Baht (THB)	34.1325
Neuer israelischer Schekel (ILS)	3.6009	Türkische Lira (TRY)	29.5340
Japanischer Yen (JPY)	140.9800	Uganda-Schilling (UGX)	3,780.0000
Malaysischer Ringgit (MYR)	4.5950	Uruguayischer Peso (UYU)	39.0400
Mexikanischer Peso (MXN)	16.9345		

f) Optionen

Die Teilfonds sind berechtigt, Call- und Put-Optionen zu zeichnen und anzukaufen. Wenn ein Teilfonds eine Option ankauft oder zeichnet, wird ein Betrag, der der vom Teilfonds gezahlten (oder erhaltenen) Prämie entspricht, als Vermögenswert oder Verbindlichkeit derselben Höhe ausgewiesen. Für den Betrag des Vermögenswerts oder der Verbindlichkeit wird anschließend eine Marktpreisbewertung vorgenommen, die den aktuellen Marktwert der Option widerspiegelt. Wenn ein Wertpapier durch die Ausübung einer Option ge- oder verkauft wird, wird die dazugehörige gezahlte (oder erhaltene) Prämie dem erworbenen Wertpapier hinzugerechnet (oder von dem erworbenen Wertpapier abgezogen) bzw. von den Erlösen aus dem Verkauf des Wertpapiers abgezogen (oder zu den Erlösen hinzugerechnet). Läuft eine Option aus (oder nimmt ein Teilfonds eine abschließende Transaktion vor), realisiert der Teilfonds einen Gewinn oder einen Verlust aus der Option, der dem Betrag der erhaltenen oder gezahlten Prämien entspricht (oder einen Gewinn oder einen Verlust, der dem Betrag entspricht, um den die Kosten für den Abschluss der Transaktion die gezahlten oder erhaltenen Prämie übersteigen).

Als Liquidationswert von Optionen, die nicht an einer Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt werden, gilt deren Nettoliquidationswert, der gemäß den Richtlinien des Verwaltungsrats der SICAV auf einer konsequent für Kontrakte dieser Art geltenden Grundlage ermittelt wird. Der Liquidationswert von Optionen, die an einer Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt werden, wird auf Grundlage des letzten verfügbaren Abrechnungskurses dieser Kontrakte an der Börse und/oder dem geregelten Markt, an denen sie durch den Teilfonds gehandelt werden, ermittelt. Falls eine Option nicht an dem Tag glattgestellt werden kann, auf den sich die Ermittlung des Nettovermögens bezieht, wird als Basis für die Ermittlung ihres Liquidationswerts ein Wert zugrunde gelegt, den der Verwaltungsrat der SICAV für vernünftig und angemessen hält.

Der Marktwert, einschließlich nicht realisierter Wertanstiege/(-rückgänge) aus Optionskontrakten, ist in der Nettovermögensaufstellung unter „Erworbenene Optionen zum Marktwert“ bzw. „Verkaufte Optionen zum Marktwert“ ausgewiesen.

Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) und die sich daraus ergebenden Nettoveränderungen der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens als „Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) aus Optionen“ bzw. „Nettoveränderung der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) aus Optionen“ ausgewiesen.

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

2 Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

g) Swaptions

Wenn ein Teilfonds eine Swaption schreibt (d. h. verkauft), wird ein Betrag in Höhe der von diesem Teilfonds vereinnahmten Prämie als Verbindlichkeit erfasst und anschließend an den aktuellen beizulegenden Zeitwert der geschriebenen Swaption angepasst. Vereinnahmte Prämien für geschriebene Swaptions, die ohne Ausübung verfallen, werden von dem betreffenden Teilfonds am jeweiligen Verfalltag als realisierte Gewinne behandelt. Wird eine geschriebene Call-Swaption ausgeübt, wird die betreffende Prämie bei der Feststellung des realisierten Gewinns oder Verlusts den Erlösen aus dem Verkauf des zugrunde liegenden Swaps hinzugefügt. Wird eine geschriebene Put-Swaption ausgeübt, reduziert die betreffende Prämie den Buchwert des gekauften Swaps.

Wenn ein Teilfonds eine Swaption kauft, wird ein Betrag in Höhe der von diesem Teilfonds bezahlten Prämie als Vermögenswert erfasst und anschließend an den aktuellen beizulegenden Zeitwert der gekauften Swaption angepasst. Gezahlte Prämien für gekaufte Swaptions, die ohne Ausübung verfallen, werden am jeweiligen Verfalltag als realisierte Verluste behandelt. Wird eine gekaufte Payer-Swaption ausgeübt, wird die betreffende Prämie bei der Feststellung, ob der jeweilige Teilfonds einen Gewinn oder einen Verlust realisiert hat, von den Erlösen aus dem zugrunde liegenden Swap abgezogen. Wird eine gekaufte Receiver-Swaption ausgeübt, wird die betreffende Prämie dem Buchwert der variabel verzinslichen Anlage hinzugefügt, für die der Swap abgeschlossen wurde.

Der Marktwert, einschließlich nicht realisierter Wertanstiege/(-rückgänge) aus Swaptions-Kontrakten, ist in der Nettovermögensaufstellung unter „Erworbenene Swaptions zum Marktwert“ bzw. „Verkaufte Swaptions zum Marktwert“ ausgewiesen.

Der realisierte Nettogewinn/(-verlust) und die sich daraus ergebenden Nettoveränderungen des nicht realisierten Gewinns/(Verlusts) werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens als „Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) aus Swaptions“ bzw. „Nettoveränderung der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) aus Swaptions“ ausgewiesen.

h) Credit Default Swap- und Credit Default Index Swap-Vereinbarungen

Eine Credit Default Swap-Vereinbarung ist ein bilateraler Finanzkontrakt, in deren Rahmen der Käufer der Absicherung eine Gebühr entrichtet, die normalerweise in jährlichen Basispunkten des Nominalwerts ausgedrückt wird, um als Gegenleistung dafür von dem Verkäufer der Absicherung beim Eintritt eines Kreditereignisses wie beispielsweise eines Konkurses, einer Zahlungsunfähigkeit oder einer Umstrukturierung eines Basiswerts eine Zahlung zu erhalten. Die Kreditereignisse und entsprechenden Zahlungsmechanismen, denen die bedingte Zahlung unterliegt, werden zwischen den Vertragsparteien bei Vertragsabschluss vereinbart.

Wurde ein Kreditereignis deklariert, hat der Käufer der Absicherung das Recht, den Vertrag zu beenden. Die Vertragsabwicklung erfolgt in aller Regel materiell, der Käufer der Absicherung hat dabei das Recht, Schuldverschreibungen des Referenzemittenten bis zu der Höhe des Nominalwertes des Vertrages zu liefern. Im Gegenzug erhält der Verkäufer der Absicherung den Nennwert dieser Schuldverschreibungen. Absicherungen zu verkaufen, ist das synthetische Äquivalent für den Kauf einer Anleihe oder einer alternativen Form von Schuldverschreibungen. Absicherungen zu kaufen, entspricht einem synthetischen Leerverkauf oder einer Absicherung einer Schuldverschreibung oder einer sonstigen Forderung.

Der Wert einer Credit Default Swap-Vereinbarung wird ermittelt, indem sie mit dem maßgebenden Par Market Swap verglichen wird. Ein Par Market Swap ist ein Swap, der zum maßgeblichen Zeitpunkt auf dem Markt ohne Austausch von Kapitalbeträgen eingegangen werden kann und dessen Deal Spread (Handelsmarge) eine solche Höhe hat, dass der Marktwert des Swaps gleich null ist. Der Spread zwischen dem ursprünglichen Default Swap und dem Par Market Swap wird anschließend als Annuität diskontiert, wobei entsprechende risikobereinigte Diskontierungssätze verwendet werden. Swap-Sätze von Par Market Swaps werden von einer repräsentativen Auswahl von Marktkontrahenten eingeholt.

Bei Credit Default Swap-Vereinbarungen auf Kreditindizes leistet eine Partei mehrere Zahlungsströme zugunsten einer anderen Partei und erwirbt dafür Anspruch auf einen bestimmten Ertrag im Falle einer Abschreibung, einer Minderung des Grundkapitals, einer Minderung der Zinsen oder des Zahlungsausfalls aller oder eines Teils der Referenzemittenten, aus denen der Kreditindex besteht. Ein Kreditindex ist eine Auswahl aus einem Korb von Kreditinstrumenten oder Engagements, die als repräsentativ für einen Teil des gesamten Kreditmarktes angesehen wird. Der Index kann unter anderem aus folgenden Komponenten bestehen: Wertpapiere mit „Investment Grade“-Rating, hochverzinsliche Wertpapiere, forderungsbesicherte Wertpapiere, Schwellenmarktpapiere und/oder verschiedenen Bonitätsratings innerhalb jedes Sektors.

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

2 Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

h) Credit Default Swap- und Credit Default Index Swap-Vereinbarungen (Fortsetzung)

Kreditindizes werden gehandelt, indem Credit Default Swap-Vereinbarungen mit standardisierten Bedingungen, d. h. u. a. einem festen Spread und standardisierte Fälligkeitsdaten eingesetzt werden. Ein Index für Credit Default Swap-Vereinbarungen bezieht sich auf alle Indexkomponenten, und bei Eintritt eines Zahlungsausfalls wird das Kreditereignis basierend auf der Gewichtung der Indexkomponente beglichen. Die Zusammensetzung der Indizes ändert sich jährlich, und in den meisten Indizes sind alle Komponenten gleich gewichtet. Die Teilfonds können Credit Default Swap-Vereinbarungen auf Kreditindizes einsetzen, um ein Portfolio aus Credit Default Swap-Vereinbarungen oder Schuldverschreibungen mit Credit Default Swap-Vereinbarungen auf Indizes abzusichern, was billiger sein kann, als viele Credit Default Swap-Vereinbarungen aufzukaufen, um den gleichen Effekt zu erzielen. Credit Default Swap-Vereinbarungen auf Indizes sind Benchmarks, die dazu dienen, Anleger, die Schuldverschreibungen halten, gegen Zahlungsausfälle abzusichern, und Händler nutzen sie, um auf Veränderungen der Bonität zu spekulieren.

Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) aus Credit Default Swap- und Credit Default Index Swap-Vereinbarungen sind in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierte Wertanstiege aus Swap-Vereinbarungen“ bzw. „Nicht realisierte Wertrückgänge aus Swap-Vereinbarungen“ ausgewiesen.

Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) und die sich daraus ergebenden Nettoveränderungen der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens als „Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) aus Swap-Vereinbarungen“ bzw. „Nettoveränderung der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) aus Swap-Vereinbarungen“ ausgewiesen.

i) Total Return Swap-Vereinbarungen

Eine Total Return Swap-Vereinbarung ist eine bilaterale Vereinbarung, bei der die beiden beteiligten Parteien übereinkommen, die gesamte Performance eines Basiswerts gegen eine Reihe von Zinszahlungen einzutauschen, welche sich auf einen Nominalwert beziehen, der als Berechnungsgrundlage herangezogen wird. Der Marktwert einer Total Return Swap-Vereinbarung wird aus dem Kurs des zugrunde liegenden Vermögenswerts ermittelt.

Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) aus Total Return Swap-Vereinbarungen sind in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierte Wertanstiege aus Swap-Vereinbarungen“ bzw. „Nicht realisierte Wertrückgänge aus Swap-Vereinbarungen“ ausgewiesen.

Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) und die sich daraus ergebenden Nettoveränderungen der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens als „Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) aus Swap-Vereinbarungen“ bzw. „Nettoveränderung der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) aus Swap-Vereinbarungen“ ausgewiesen.

j) Zins- und Währungsswap-Vereinbarungen

Die Teilfonds können bei der Verfolgung ihrer Anlageziele einem Zinsrisiko ausgesetzt sein. Der Wert von vom Teilfonds gehaltenen festverzinslichen Schuldverschreibungen kann bei steigenden Zinssätzen sinken. Um den Teilfonds gegen dieses Risiko abzusichern und seine Fähigkeit zu erhalten, Erträge zu den gültigen Marktpreisen zu erzielen, kann der Teilfonds Zinsswap-Vereinbarungen eingehen. Eine Zinsswap-Vereinbarung ist eine bilaterale Vereinbarung, bei der die Vertragsparteien vereinbaren, eine Reihe von Zinszahlungen gegen eine andere Reihe von Zinszahlungen (gewöhnlich fest/variabel) auf der Grundlage eines Nominalwerts zu tauschen, der als Rechnungsgrundlage dient und in der Regel nicht getauscht wird. Für alle Zinsswap-Vereinbarungen, deren Index für den variablen Zinssatz täglich neu bestimmt wird, werden „Dirty Prices“ (Kurse zuzüglich der aufgelaufenen Stückzinsen) verwendet. Die davon betroffenen Währungen sind der brasilianische Real, der kanadische Dollar, das britische Pfund und der japanische Yen.

Bei Währungsswap-Vereinbarungen kommen zwei Parteien überein, zwei verschiedene Währungen auszutauschen, mit der Vereinbarung, dass dieser Austausch zu einem späteren Zeitpunkt zu bestimmten Kursen umgekehrt ausgeführt wird. Der Austausch der Währungen zu Beginn der Vertragslaufzeit erfolgt zum aktuellen Devisenkassakurs. Der Rücktausch bei Fälligkeit kann zum gleichen Kurs, einem festgelegten Kurs oder zum tagesaktuellen Devisenkassakurs erfolgen. Falls Zinszahlungen anfallen, werden diese auf Grundlage der Zinssätze, die zu Beginn der Vertragslaufzeit in beiden Währungen gültig waren, zwischen den Vertragsparteien abgewickelt.

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

2 Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

j) Zins- und Währungsswap-Vereinbarungen (Fortsetzung)

Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) aus Zinsswap- und Währungsswap-Vereinbarungen sind in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierte Wertanstiege aus Swap-Vereinbarungen“ bzw. „Nicht realisierte Wertrückgänge aus Swap-Vereinbarungen“ ausgewiesen.

Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) und die sich daraus ergebenden Nettoveränderungen der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens als „Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) aus Swap-Vereinbarungen“ bzw. „Nettoveränderung der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) aus Swap-Vereinbarungen“ ausgewiesen.

k) Inflationsswap-Vereinbarungen

Die Teilfonds können Inflationsswap-Vereinbarungen abschließen, um sich gegen Inflation abzusichern. Gemäß der Inflationsswap-Vereinbarung vereinbaren die Teilfonds mit einer Gegenpartei den Austausch regelmäßiger Zahlungsströme, die auf einem Referenz-Inflationsindex basieren. Einer der Zahlungsströme ist in der Regel eine variable Zahlung, die an den festgelegten Inflationsindex gekoppelt ist, bei dem anderen Zahlungsstrom handelt es sich meist um einen festen Zinssatz. Inflationsswaps werden normalerweise auf Nullkupon-Basis abgeschlossen, d. h. alle Zahlungen laufen während der Vertragslaufzeit auf und werden bei Beendigung oder Fälligkeit des Vertrags saldiert. Inflationsswap-Vereinbarungen unterliegen Schwankungen des Zinsniveaus.

Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) aus Inflationsswap-Vereinbarungen sind in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierte Wertanstiege aus Swap-Vereinbarungen“ bzw. „Nicht realisierte Wertrückgänge aus Swap-Vereinbarungen“ ausgewiesen.

Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) und die sich daraus ergebenden Nettoveränderungen der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens als „Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) aus Swap-Vereinbarungen“ bzw. „Nettoveränderung der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) aus Swap-Vereinbarungen“ ausgewiesen.

l) Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Die Teilfonds können zusätzlich auch Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließen, die im Kauf und Wiederverkauf von Wertpapieren bestehen. Bei einem Pensionsgeschäft verkauft ein Teilfonds einem Finanzinstitut ein Wertpapier aus seinem Portfolio und verpflichtet sich zugleich, dieses Wertpapier zu einem vereinbarten Preis und zu einem vereinbarten Datum wieder zurückzukaufen. Bei einem typischen umgekehrten Pensionsgeschäft übernimmt der Teilfonds einen zugrundeliegenden Schuldschein (Collateral) unter der Bedingung, dass sich der Verkäufer dazu verpflichtet, den Schuldschein zu einem zuvor festgelegten Preis und einem zuvor festgelegten Zeitpunkt von dem Teilfonds zurückzukaufen. Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte werden zu ihrem Nominalwert bewertet.

Der Marktwert, einschließlich nicht realisierter Wertanstiege/(-rückgänge) aus Pensionsgeschäften und umgekehrten Pensionsgeschäften, ist in der Nettovermögensaufstellung unter „Pensionsgeschäfte“ bzw. „umgekehrte Pensionsgeschäfte“ ausgewiesen.

m) Befristete Darlehen

Der Teilfonds kann durch eine Abtretung / einen Transfer oder durch eine Beteiligung an der Gesamtheit oder einem Teil des ausstehenden Darlehensbetrags in variabel und festverzinsliche Anleihen eines oder mehrerer Finanzinstitute investieren. Wenn ein Teilfonds Anteile an Darlehen erwirbt, trägt er damit das mit dem betrieblichen Darlehensnehmer einhergehende wirtschaftliche Risiko und das Kreditrisiko, das mit einer vermittelnden Bank oder einem Finanzvermittler verbunden ist. Die Darlehensanteile oder Abtretungen, in die ein Teilfonds zu investieren beabsichtigt, verfügen nicht zwangsläufig über ein Bonitätsrating einer internationalen Ratingagentur. Wenn der Teilfonds Darlehensabtretungen erwirbt, trägt er damit einzig das Kreditrisiko, das sich im Zusammenhang mit dem betrieblichen Darlehensnehmer ergibt.

Der Wert eines Darlehens wird daher umsichtig und in gutem Glauben vom Verwaltungsrat der SICAV basierend auf vorhersehbaren Kauf- und Verkaufspreisen bestimmt.

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

2 Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

m) Befristete Darlehen (Fortsetzung)

Der Marktwert, einschließlich nicht realisierter Wertanstiege/(-rückgänge) aus befristeten Darlehen, ist in der Nettovermögensaufstellung unter „Anlagen zum Marktwert“ ausgewiesen.

Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) und die sich daraus ergebenden Nettoveränderungen der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens als „Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) aus Anlagen“ bzw. „Nettoveränderung der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) aus Anlagen“ ausgewiesen.

n) Optionsscheine

Die Teilfonds können Optionsscheine kaufen oder auf sonstige Weise erhalten. Optionsscheine verleihen dem Inhaber das Recht, ein Wertpapier in der Zukunft zu einem festgelegten Preis zu kaufen. Börsennotierte Optionsscheine werden mit dem Preis bewertet, zu dem sie zuletzt an der maßgeblichen Börse oder ihrem Hauptmarkt gehandelt wurden. Die Bewertung nicht börsennotierter Optionsscheine wird mittels eines unabhängigen Berechnungsmodells ermittelt, um den Zeitwert des Optionsscheins unter Bezugnahme auf das zugrunde liegende Wertpapier zu erfassen.

Der Marktwert, einschließlich nicht realisierter Wertanstiege/(-rückgänge) aus Optionsscheinen, ist in der Nettovermögensaufstellung unter „Anlagen zum Marktwert“ ausgewiesen.

Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) und die sich daraus ergebenden Nettoveränderungen der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens als „Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) aus Anlagen“ bzw. „Nettoveränderung der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) aus Anlagen“ ausgewiesen.

o) „To be announced“-Wertpapiere

Der Teilfonds kann anzukündigende Wertpapiere („To be announced“-Wertpapiere oder „TBAs“) kaufen. Anzukündigende Wertpapiere sind Terminkontrakte auf hypothekenbesicherte Wertpapiere, die von staatlichen Stellen begeben werden. Zum Zeitpunkt des Kaufs sind die konkreten Wertpapiere nicht bekannt, jedoch sind ihre Hauptmerkmale festgelegt. Obwohl der Preis zum Zeitpunkt des Kaufs festgelegt wurde, ist der Kapitalbetrag noch nicht abschließend bestimmt. Der Kauf von anzukündigenden Wertpapieren ist mit einem Verlustrisiko verbunden, wenn der Wert der zu kaufenden Wertpapiere vor dem Abwicklungsdatum sinkt.

Der Marktwert, einschließlich nicht realisierter Wertanstiege/(-rückgänge) aus anzukündigenden Wertpapieren (TBAs), ist in der Nettovermögensaufstellung unter „Anlagen zum Marktwert“ ausgewiesen.

Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) und die sich daraus ergebenden Nettoveränderungen der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens als „Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) aus Anlagen“ bzw. „Nettoveränderung der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) aus Anlagen“ ausgewiesen.

p) Collateralized Debt Obligations („CDOs“)

Zu den Collateralized Debt Obligations zählen Collateralized Bond Obligations („CBOs“), Collateralized Loan Obligations („CLOs“) und andere ähnlich strukturierte Wertpapiere. CBOs und CLOs sind Arten von forderungsbesicherten Wertpapieren (Asset-Backed Securities). Ein CBO ist ein Trust, der durch einen diversifizierten Pool von hochriskanten festverzinslichen Wertpapieren unterhalb von „Investment Grade“ abgesichert ist. Ein CLO ist ein Trust, der in der Regel durch einen Pool von Darlehen besichert ist, zu denen unter anderem inländische und ausländische vorrangige besicherte Darlehen, vorrangige unbesicherte Darlehen und nachrangige Unternehmensdarlehen gehören können, einschließlich Darlehen, die mit einem Rating unterhalb von „Investment Grade“ bewertet sein können, oder gleichwertiger unbewerteter Darlehen. Das Risiko einer Anlage in einem CDO hängt weitgehend von der Art der Wertpapiersicherheiten und der Klasse des CDO ab, in den ein Fonds investiert. Zusätzlich zu den normalen Risiken im Zusammenhang mit festverzinslichen Wertpapieren, die an anderer Stelle in diesem Bericht und im Emissionsprospekt der Fonds erörtert werden (z. B. Vorauszahlungsrisiko, Kreditrisiko, Liquiditätsrisiko, Marktrisiko, strukturelles Risiko, rechtliches Risiko und Zinsrisiko (das verstärkt sein kann, wenn sich der für eine strukturierte Finanzierung zu zahlende Zinssatz auf der Grundlage von Multiplikationsfaktoren von Zinsänderungen oder umgekehrt zu Zinsänderungen ändert)), bergen CBOs, CLOs und andere CDOs zusätzliche Risiken, wie etwa: (i) die Möglichkeit, dass Ausschüttungen aus Wertpapiersicherheiten nicht ausreichen, um Zinszahlungen oder andere Zahlungen zu leisten, (ii) die Qualität der Sicherheiten kann an Wert verlieren oder die Sicherheiten können ausfallen, (iii) ein Fonds kann in CBOs, CLOs oder andere CDOs investieren, die nachrangig zu anderen Klassen sind.

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

2 Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

p) Collateralized Debt Obligations („CDOs“) (Fortsetzung)

Der Marktwert, einschließlich nicht realisierter Wertanstiege/(-rückgänge) aus CDOs, ist in der Nettovermögensaufstellung unter „Anlagen zum Marktwert“ ausgewiesen.

Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) und die sich daraus ergebenden Nettoveränderungen der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens als „Realisierte Nettowertanstiege/(-rückgänge) aus Anlagen“ bzw. „Nettoveränderung der nicht realisierten Wertanstiege/(-rückgänge) aus Anlagen“ ausgewiesen.

q) Barmittel und barmittelähnliche Anlagen

Barmittel und barmittelähnliche Anlagen werden zu ihrem Nennwert zuzüglich aufgelaufener Zinsen auf Grundlage ihres Restbuchwertes bewertet. Zinsen für Überziehungskredite werden ebenfalls abgegrenzt.

Alle Bankguthaben werden entweder bei Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. angelegt, als täglich fällige Anlagen bei einer Drittpartei, die vom Verwaltungsrat der SICAV genehmigt wurde, oder direkt bei einem Zwischenverwahrer. Barmittel und barmittelähnliche Anlagen beinhalten ferner Rücklagen für die Sicherheitsmarge bei Finanzterminkontrakten und verpfändete Sicherheiten für Swap-Vereinbarungen und Pensionsgeschäfte.

r) Zinserträge und Zinsaufwendungen

Zinserträge, bereinigt um den Zuwachs von Abschlägen und die Abschreibung von Aufschlägen, und Zinsaufwendungen werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens periodengerecht nach Abzug der Quellensteuer aufgeführt. Die Bezahlung der Prämie für Wandelanleihen erfolgt normalerweise unter Einschluss einer Prämie für die Umwandlungsoption. Die Anpassung der Zinserträge für die Tilgung der für Wandelanleihen zu bezahlenden Prämie kann daher einen negativen Zinsertrag zur Folge haben.

s) Dividendenerträge

Dividendenerträge werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens zu ihrem Ex-Dividendendatum nach Abzug der Quellensteuer erfasst.

t) Sonstige Erträge

Der Titel „Sonstige Erträge“ in Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens umfasst außerordentliche Erträge.

u) Gründungskosten

Die Gründungskosten der SICAV wurden aktiviert und werden über einen Zeitraum von fünf Jahren abgeschrieben. Die Aufwendungen zur Errichtung neuer Teilfonds werden ebenfalls aktiviert und über einen Zeitraum von höchstens fünf Jahren abgeschrieben.

v) Ausschüttung von Dividenden

Mit Ausnahme von Aktien der Dividendenklassen B, C, D, DR, G, I, K, M, Q, R, S, Y und ZR werden alle Teilfonds gemäß ihrer Anlagepolitik sämtliche Erträge und Kapitalgewinne thesaurieren und keine Dividenden auszahlen. Jedoch hat der Verwaltungsrat der SICAV, falls er dies für angebracht hält, in jedem Geschäftsjahr das Recht, den Aktionären eines beliebigen Teilfonds oder einer beliebigen Aktienklasse auf der jährlichen Generalversammlung die Auszahlung einer Dividende aus den gesamten aktuellen Nettoanlageerträgen oder aus einem Teil der aktuellen Nettoanlageerträge dieses Teilfonds oder dieser Aktienklasse anzubieten. Zur Vermeidung von Zweifeln wird festgelegt, dass der Nettoanlageertrag keine Kapitalzuwächse umfasst. Der Verwaltungsrat der SICAV kann zu jedem Zeitpunkt des jeweiligen Geschäftsjahres die Ausschüttung von Zwischendividenden beschließen. Der Verwaltungsrat der SICAV kann die Ausschüttung einer Dividende nur vorschlagen, wenn das Kapital der SICAV nach der Ausschüttung über dem nach Luxemburger Recht vorgesehenen Mindestkapital liegt.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

2 Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

v) Ausschüttung von Dividenden (Fortsetzung)

Es besteht jedoch die Möglichkeit, in Zukunft verschiedene Arten von Ausschüttungsklassen aufzulegen. Bei bereits aufgelegten Ausschüttungsklassen gab es in Bezug auf deren Häufigkeit und Verteilung keine Änderungen.

w) Transaktionskosten

Den Teilfonds entstanden Transaktionskosten, die als Brokergebühren im Zusammenhang mit dem Kauf oder Verkauf von Wertpapieren und Derivaten eingestuft werden. Die Transaktionskosten für Anleihen sind im Spread enthalten. Die Transaktionskosten werden auf Kassenbasis ausgewiesen und werden bei ihrer Entstehung oder Rechnungsstellung auf der Grundlage des Nettovermögens des Teilfonds entrichtet, dem sie zuzurechnen sind. Diese Kosten werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettofondsvermögens als Aufwand ausgewiesen.

x) Rechnungslegungsrelevante Schätzungen

Die Erstellung des Rechnungsabschlusses in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen und regulatorischen Vorschriften zur Erstellung der Abschlüsse erfordert vom Verwaltungsrat der SICAV bestimmte Schätzungen und Annahmen, welche die ausgewiesenen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten sowie den für den Berichtszeitraum ausgewiesenen Aufwand und Ertrag beeinflussen. Die tatsächlichen Ergebnisse können von diesen Schätzungen abweichen. Zum Abschlussdatum existierten keine Schätzungen und Annahmen mit einem beträchtlichen Risiko, dass eine wesentliche Berichtigung der Buchwerte der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten erforderlich ist.

y) Swing-Pricing

Ein Teilfonds kann beim Handel der zugrunde liegenden Anlagen infolge von Nettozuflüssen oder Nettoabflüssen einen als „Verwässerung“ bezeichneten Wertverlust erleiden. Dies kann auf eine Reihe von Faktoren zurückzuführen sein, einschließlich insbesondere Geld-Brief-Spannen und Transaktionskosten zugrunde liegender Wertpapiere, Steuern, fiskalische und andere anwendbare Handelsgebühren, Zeichnungs- und Rücknahmegebühren zugrunde liegender Fonds (sofern sie anfallen), die vorherrschende Liquidität und die Größe der Transaktion an den Märkten, in denen die Teilfonds anlegen. Um diesem Effekt entgegenzuwirken und die Interessen der Anteilhaber zu schützen, kann die Verwaltungsgesellschaft einen Swing-Pricing-Mechanismus einsetzen. Falls an einem Bewertungstag die Gesamtheit der Netto-Anlegertransaktionen in einem Teilfonds einen vorab festgelegten Schwellenwert übersteigt, kann der Nettoinventarwert je Anteil nach oben oder unten korrigiert werden, um die Kosten widerzuspiegeln, die den Nettozuflüssen bzw. -abflüssen zuzuschreiben sind. Die maximale Anpassung beträgt unter normalen Umständen 2% des Nettoinventarwerts. Der Verwaltungsrat behält sich das Recht vor, den Swing-Faktor unter außergewöhnlichen Umständen auf maximal 5% zu erhöhen.

Periodisch wird geprüft, ob der angewendete Swing-Faktor angemessen ist. Im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 wurde Swing-Pricing von den Teilfonds BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay High Yield ESG Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Select Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Global Convertible Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund, BlueBay Funds – BlueBay Financial Capital Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund, BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Structured Credit Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund und BlueBay Funds – BlueBay Impact-Aligned Bond Fund angewandt. Die Auswirkungen des Swing-Pricing auf das Nettovermögen der Teilfonds zum Ende des Berichtszeitraums beliefen sich auf null.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

3 Besteuerung

Entsprechend der geltenden Luxemburger Steuergesetzgebung und -praxis unterliegt die SICAV in Luxemburg keiner Einkommensteuerpflicht; außerdem unterliegen Ausschüttungen (einschließlich der Ausschüttung von Liquidationserlösen), Rücknahmen oder Zahlungen, die die SICAV für die Aktien an ihre Aktionäre leistet, in Luxemburg keiner Quellensteuer.

Die SICAV unterliegt jedoch in Luxemburg in der Regel einer Zeichnungssteuer („taxe d'abonnement“) von jährlich 0.05%, die vierteljährlich zahlbar ist. Die Bemessungsgrundlage für die Zeichnungssteuer ist das gesamte Nettovermögen der SICAV gemäß der Bewertung am letzten Tag jedes Quartals eines Kalenderjahres.

Ein Steuersatz von 0.01% pro Jahr gilt jedoch für:

- Organismen, deren ausschließlicher Zweck die gemeinsame Anlage in Geldmarktinstrumenten und Einlagen bei Kreditinstituten ist; und
- einzelne Teilfonds von Organismen für gemeinsame Anlagen („OGA“) mit mehreren Teilfonds sowie einzelne Wertpapierklassen, die innerhalb eines OGA oder innerhalb eines Teilfonds eines OGA mit mehreren Teilfonds ausgegeben wurden, sofern die Wertpapiere solcher Teilfonds oder Klassen ausschließlich einem oder mehreren institutionellen Anlegern vorbehalten sind.

Weitere Befreiungen von der Zeichnungssteuer sind im Verkaufsprospekt angegeben.

In Luxemburg ist im Allgemeinen auf die Ausgabe von Aktien der SICAV gegen bar keine Stempelgebühr oder sonstige Steuer zu zahlen.

Auf realisierte oder nicht realisierte Wertsteigerungen der Aktiva der SICAV ist in Luxemburg keine Körperschaftsteuer zu zahlen.

Von der SICAV erzielte Zinserträge können einer nicht rückerstattbaren Quellensteuer im jeweiligen Herkunftsland unterliegen. Obwohl nicht erwartet wird, dass die realisierten kurzfristigen oder langfristigen Kapitalgewinne der SICAV in einem anderen Land steuerpflichtig werden, müssen sich die Aktionäre bewusst sein und anerkennen, dass eine solche Möglichkeit nicht vollständig ausgeschlossen ist. Die regelmäßigen Erträge der SICAV aus einigen ihrer Wertpapiere sowie die Zinsen für Bareinlagen in bestimmten Ländern unterliegen möglicherweise einer Quellensteuer zu unterschiedlichen Sätzen, die normalerweise nicht erstattbar ist. Quellensteuern und andere an der Quelle erhobene Steuern sind, soweit sie anfallen, nicht erstattbar. Ob die SICAV von einem von Luxemburg abgeschlossenen Doppelbesteuerungsabkommen profitieren kann, muss jeweils im Einzelfall beurteilt werden.

Anleger sollten zur steuerlichen Situation in den jeweiligen Ländern ihrer Staatsangehörigkeit, ihres Wohnortes oder ihres gewöhnlichen Aufenthalts ihre professionellen Berater zu Rate ziehen.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

4 Dividendenzahlungen

Der Verwaltungsrat der SICAV beabsichtigt eine jährliche Ausschüttung, die am letzten Geschäftstag im Juni erfolgt. Es gibt drei Arten von Ausschüttungen: In mit „(ACDiv)“, „(AFDiv)“, „(AIDiv)“ und „(AKDiv)“ gekennzeichneten Klassen erfolgt die Ausschüttung jährlich; in mit „(QCDiv)“, „(QFDiv)“, „(QIDiv)“ und „(QKDiv)“ gekennzeichneten Klassen erfolgt die Ausschüttung quartalsweise am jeweils letzten Geschäftstag der Monate März, Juni, September und Dezember; in mit „(MCDiv)“, „(MFDiv)“, „(MIDiv)“ und „(MKDiv)“ gekennzeichneten Klassen erfolgt die Ausschüttung auf monatlicher Basis, und zwar jeweils am letzten Geschäftstag des Monats.

Die für die verschiedenen Kategorien von ausschüttenden Aktienklassen geltende Dividendenpolitik ist nachstehend angegeben:

Klassifizierung	Politik
(CDiv)	Der Verwaltungsrat geht davon aus, dass er im Wesentlichen alle Nettoanlageerträge und alle realisierten Nettokapitalgewinne, die in dem für die Dividendenausschüttung relevanten Zeitraum in den einzelnen Aktienklassen angefallen sind, zur Ausschüttung vorschlagen wird.
(FDiv)	Der Dividendensatz wird als Prozentsatz des Nettoinventarwerts je Aktie für jede Klasse festgelegt, wie jeweils vom Verwaltungsrat bestimmt. Die Register- und Transferstelle teilt die aktuellen Dividendensätze auf Anfrage mit. Anleger werden darauf hingewiesen, dass der Verwaltungsrat die festen Dividendensätze nach eigenem Ermessen festlegt und dabei verschiedene Faktoren berücksichtigt, darunter die Nettoerträge und den Kapitalzuwachs des betreffenden Teilfonds nach Abzug der im jeweiligen Zeitraum anfallenden Gebühren und Kosten. Gelegentlich können Dividenden aus dem Kapital der jeweiligen Klasse gezahlt werden. Nach alleinigem Ermessen des Verwaltungsrats kann jährlich eine zusätzliche Dividende erklärt werden. Der Nettoinventarwert solcher Klassen kann aufgrund der häufigeren Dividendenausschüttungen stärker schwanken kann als bei anderen Klassen. Der Verwaltungsrat kann Betrag und Zeitpunkt der Dividendenzahlungen nach eigenem Ermessen ändern, wenn er dies für notwendig hält, um den aktuellen Marktbedingungen Rechnung zu tragen.
(IDiv)	Der Verwaltungsrat geht davon aus, dass er im Wesentlichen alle Nettoanlageerträge der einzelnen Aktienklassen in dem für die Dividendenausschüttung relevanten Zeitraum zur Ausschüttung vorschlagen wird.
(KDiv)	Der Verwaltungsrat geht davon aus, dass er im Wesentlichen alle Nettoanlageerträge und alle realisierten Nettokapitalgewinne, die in dem für die Dividendenausschüttung relevanten Zeitraum in den einzelnen Aktienklassen angefallen sind, zur Ausschüttung vorschlagen wird. Falls der Nettoinventarwert einer Klasse am Ende des für die Dividendenausschüttung relevanten Zeitraums unter dem ursprünglichen Angebotspreis dieser Klasse liegt, erfolgt keine Ausschüttung.

Die nachfolgenden Tabellen zeigen die Dividenden, die von den Teilfonds in dem am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum ausgezahlt worden sind:

Teilfonds	Aktienklasse*	Ex-Dividendendatum	Dividende pro Aktie (USD)
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund	D - GBP (QIDiv)	29. September 2023	2.690
	DR - GBP (QIDiv)	29. September 2023	2.444

Teilfonds	Aktienklasse*	Ex-Dividendendatum	Dividende pro Aktie (EUR)
BlueBay Funds – BlueBay High Yield ESG Bond Fund	D - GBP (QIDiv)	29. September 2023	1.919
		29. Dezember 2023	1.986
	DR - GBP (QIDiv)	29. September 2023	1.719
		29. Dezember 2023	1.777
	M - USD (MIDiv)	30. November 2023	0.241
		29. Dezember 2023	0.433
	V - GBP (QIDiv)	29. September 2023	0.040
		29. Dezember 2023	1.862
V - USD (QIDiv)	29. September 2023	0.029	
	29. Dezember 2023	1.393	

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

4 Dividendenzahlungen (Fortsetzung)

Teilfonds	Aktienklasse*	Ex-Dividendendatum	Dividende pro Aktie (EUR)
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund	D - GBP (QIDiv)	29. September 2023	1.236
		29. Dezember 2023	1.317
	DR - GBP (QIDiv)	29. September 2023	1.247
		29. Dezember 2023	1.328

Teilfonds	Aktienklasse*	Ex-Dividendendatum	Dividende pro Aktie (USD)
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund	D - GBP (QIDiv)	29. September 2023	0.719
		29. Dezember 2023	0.640
	DR - GBP (QIDiv)	29. September 2023	0.723
		29. Dezember 2023	0.643

Teilfonds	Aktienklasse*	Ex-Dividendendatum	Dividende pro Aktie (USD)	
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund	DR - GBP (QIDiv)	29. September 2023	1.745	
		29. Dezember 2023	1.525	
	R - SGD (MIDiv)	31. Juli 2023	0.198	
		31. August 2023	0.290	
			29. September 2023	0.220
			31. Oktober 2023	0.209
			30. November 2023	0.219
			29. Dezember 2023	0.199

Teilfonds	Aktienklasse*	Ex-Dividendendatum	Dividende pro Aktie (USD)
BlueBay Funds – BlueBay Global Convertible Bond Fund	D - GBP (QIDiv)	29. September 2023	1.880
		29. Dezember 2023	2.126
	DR - GBP (QIDiv)	29. September 2023	1.492
		29. Dezember 2023	1.684

Teilfonds	Aktienklasse*	Ex-Dividendendatum	Dividende pro Aktie (USD)
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund	C - EUR (QIDiv)	29. September 2023	2.560
		29. Dezember 2023	3.189
	C - USD (QIDiv)	29. September 2023	2.318
		29. Dezember 2023	2.975
	Q - GBP (QIDiv)	29. Dezember 2023	0.909
	S - CAD (QIDiv)	29. September 2023	1.728
		29. Dezember 2023	2.186
	S - GBP (QIDiv)	29. September 2023	2.182
		29. Dezember 2023	2.726

Teilfonds	Aktienklasse*	Ex-Dividendendatum	Dividende pro Aktie (EUR)
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund	S - EUR (QIDiv)	29. September 2023	0.470
		29. Dezember 2023	0.518

Teilfonds	Aktienklasse*	Ex-Dividendendatum	Dividende pro Aktie (EUR)
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund	I - EUR (QIDiv)	29. September 2023	0.582
		29. Dezember 2023	0.612
	S - EUR (QIDiv)	29. September 2023	0.591
		29. Dezember 2023	0.622

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

4 Dividendenzahlungen (Fortsetzung)

Teilfonds	Aktienklasse*	Ex-Dividendendatum	Dividende pro Aktie (USD)
BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund	D - GBP (QIDiv)	29. September 2023	1.819
		29. Dezember 2023	1.863
	Q - GBP (QIDiv)	29. September 2023	1.773
		29. Dezember 2023	1.819
	Q - USD (QIDiv)	29. September 2023	1.476
		29. Dezember 2023	1.556
	S - USD (QIDiv)	29. September 2023	1.532
		29. Dezember 2023	1.615

Teilfonds	Aktienklasse*	Ex-Dividendendatum	Dividende pro Aktie (EUR)
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund	D - GBP (QIDiv)	29. September 2023	1.087
		29. Dezember 2023	1.149
	K - EUR (QKDiv)	29. September 2023	0.706
		29. Dezember 2023	0.746

Teilfonds	Aktienklasse*	Ex-Dividendendatum	Dividende pro Aktie (USD)
BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund	I - USD (MIDiv)	31. Juli 2023	0.326
		31. August 2023	0.418
		29. September 2023	0.349
		31. Oktober 2023	0.401
		30. November 2023	0.375
		29. Dezember 2023	0.364
	Q - CHF (QIDiv)	29. September 2023	1.084
		29. Dezember 2023	1.099
	Q - GBP (QIDiv)	29. September 2023	1.426
		29. Dezember 2023	1.448
	Q - USD (QIDiv)	29. September 2023	1.152
		29. Dezember 2023	1.202
	R - CHF (QIDiv)	29. September 2023	1.074
		29. Dezember 2023	1.101
	R - EUR (QIDiv)	29. September 2023	1.004
		29. Dezember 2023	1.051
	R - GBP (QIDiv)	29. September 2023	1.102
		29. Dezember 2023	1.146
	R - USD (QIDiv)	29. September 2023	0.758
		29. Dezember 2023	1.296
	S - AUD (QIDiv)	29. September 2023	0.741
		29. Dezember 2023	0.749
	S - EUR (QIDiv)	29. September 2023	1.149
		29. Dezember 2023	1.164
	S - GBP (QIDiv)	29. September 2023	1.359
		29. Dezember 2023	1.380
	S - USD (QIDiv)	29. September 2023	1.088
		29. Dezember 2023	1.135
	Y - GBP (MIDiv)	31. August 2023	0.224
		29. September 2023	0.489
		31. Oktober 2023	0.555
		30. November 2023	0.530
		29. Dezember 2023	0.527

Teilfonds	Aktienklasse*	Ex-Dividendendatum	Dividende pro Aktie (USD)
BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund	C - EUR (QIDiv)	29. September 2023	1.363
		29. Dezember 2023	1.453
	C - GBP (QIDiv)	29. September 2023	1.650
		29. Dezember 2023	1.427
	C - USD (QIDiv)	29. September 2023	1.427
		29. Dezember 2023	1.295
I - GBP (QIDiv)	29. September 2023	1.833	
	29. Dezember 2023	1.614	

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

4 Dividendenzahlungen (Fortsetzung)

Teilfonds	Aktienklasse*	Ex-Dividendendatum	Dividende pro Aktie (USD)
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund	K - GBP (MIDiv)	31. Juli 2023	0.445
		31. August 2023	1.111
		29. September 2023	0.833
		31. Oktober 2023	0.852
		30. November 2023	0.825
		29. Dezember 2023	0.760
	Q - EUR (QIDiv)	29. September 2023	1.882
		29. Dezember 2023	1.576

Teilfonds	Aktienklasse*	Ex-Dividendendatum	Dividende pro Aktie (USD)
BlueBay Funds – BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund	C - EUR (CPerf)-(QIDiv)	29. September 2023	1.190
		29. Dezember 2023	1.203

Teilfonds	Aktienklasse*	Ex-Dividendendatum	Dividende pro Aktie (USD)
BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund	S - EUR (QIDiv)	29. September 2023	1.596
		29. Dezember 2023	1.630
	S - GBP (QIDiv)	29. September 2023	1.902
		29. Dezember 2023	1.947
	S - USD (QIDiv)	29. September 2023	1.534
		29. Dezember 2023	1.615

Teilfonds	Aktienklasse*	Ex-Dividendendatum	Dividende pro Aktie (EUR)
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Structured Credit Fund	G - GBP (QIDiv)	29. September 2023	1.779
		29. Dezember 2023	1.953
	G - USD (QIDiv)	29. September 2023	1.462
		29. Dezember 2023	1.651

Teilfonds	Aktienklasse*	Ex-Dividendendatum	Dividende pro Aktie (USD)
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund	G - USD (MIDiv)	31. Juli 2023	0.708
		31. August 2023	0.805
		29. September 2023	0.768
		31. Oktober 2023	0.824
		30. November 2023	0.921
		29. Dezember 2023	0.636

Teilfonds	Aktienklasse*	Ex-Dividendendatum	Dividende pro Aktie (USD)
BlueBay Funds – BlueBay Impact – Aligned Bond Fund	C - GBP (QIDiv)	29. September 2023	1.137
		29. Dezember 2023	1.222
	G - EUR (QIDiv)	29. September 2023	1.003
		29. Dezember 2023	1.071
	G - GBP (QIDiv)	29. September 2023	1.198
		29. Dezember 2023	1.282
S - GBP (QIDiv)	29. Dezember 2023	0.403	

Teilfonds	Aktienklasse*	Ex-Dividendendatum	Dividende pro Aktie (USD)
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Government Bond Fund	Q - GBP (QIDiv)	29. Dezember 2023	0.313

Teilfonds	Aktienklasse*	Ex-Dividendendatum	Dividende pro Aktie (USD)
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Financials Plus Bond Fund	C - GBP (QCDiv)	29. Dezember 2023	9.187
	S - GBP (QIDiv)	29. Dezember 2023	0.528

* Einzelheiten zu den Daten, an denen die Aktienklassen im Laufe des Berichtszeitraums aufgelegt oder geschlossen wurden, entnehmen Sie bitte Anhang 1.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

5 Gebühren und Aufwendungen

a) *Gebühren der Administrations-, Depot-, Zahl-, Register-, Transfer- und Notierungsstelle sowie der Hauptverwaltung*

Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. erhält aus dem Vermögen der einzelnen Klassen der Teilfonds BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay High Yield ESG Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund, BlueBay Funds – BlueBay Financial Capital Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund, BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund und BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Structured Credit Fund für ihre Dienstleistungen als Depotstelle, Administrationsstelle, Hauptverwaltung, Zahl-, Register-, Transfer- und Notierungsstelle eine gemäß der in Luxemburg üblichen Bankpraxis berechnete Gebühr. Darüber hinaus hat Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. der SICAV gegenüber Anspruch auf Rückerstattung aller angemessenen Spesen und Auslagen sowie der von eventuellen Korrespondenzbanken erhobenen Gebühren.

b) *All-in-Administrationsgebühren*

Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. erhält aus dem Vermögen der einzelnen Klassen der Teilfonds BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Select Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Global Convertible Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay High Grade Structured Credit Short Duration Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade ESG Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Impact-Aligned Bond Fund, BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Government Bond Fund und BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Financials Plus Bond Fund eine All-in-Administrationsgebühr auf Grundlage des Nettoinventarwerts des Fonds. Die Gebühr umfasst Kosten für die globalen Verwahr-, Depotstellen-, Fondsbuchhaltungs- und -verwaltungs-, Fonds-Compliance- und Transferstellen-Dienstleistungen, die Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A für den Fonds erbringt. Die All-in-Gebühr ist monatlich zu entrichten.

c) *Sonstige Gebühren und Aufwendungen*

Die SICAV trägt alle ihre Betriebs- und Verwaltungskosten. Hierzu zählen unter anderem: Gründungskosten, wie z. B. die Kosten der Vorbereitung und der Registrierung; die in Luxemburg auf das Vermögen erhobene „taxe d'abonnement“, angemessene Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder der SICAV; der Verwaltungsgesellschaft im Namen der SICAV entstandene Aufwendungen; Kosten und Aufwendungen für Rechtsberatung und Wirtschaftsprüfer; laufende Registrierungs- und Börsennotierungskosten, einschließlich Übersetzungskosten und die Kosten und Aufwendungen im Zusammenhang mit der Erstellung, dem Druck und der Verteilung des Verkaufsprospekts, der Key Investor Information Documents („KIIDs“), der Finanzberichte und anderer Dokumente, die den Aktionären zur Verfügung gestellt werden.

d) *Feste Gebühren und Aufwendungen*

Der Gesamtbetrag, der den einzelnen Klassen jedes Teilfonds für die entstandenen Gebühren und Aufwendungen im Zusammenhang mit den vorstehend genannten Dienstleistungen in Rechnung gestellt wird, wird als fester Prozentsatz des Nettovermögens der jeweiligen Klasse festgesetzt. Grundlage hierfür bilden die Festlegungen der Verwaltungsgesellschaft und der SICAV gemäß der Aufwandsvereinbarung vom 1. Juli 2011 in ihrer geänderten Fassung vom 31. Juli 2018. Der feste Prozentsatz der Gebühren und Aufwendungen für die einzelnen Klassen jedes Teilfonds wird im Verkaufsprospekt festgelegt und wird jährlich überprüft. Alle Gebühren und Aufwendungen, die diesen festen Prozentsatz übersteigen, werden von der Verwaltungsgesellschaft getragen. Wird der feste Prozentsatz nicht erreicht, zahlt der Teilfonds der Verwaltungsgesellschaft die Differenz. Alle Zahlungen von oder an Teilfonds infolge des Mechanismus der festen Gebühren und Aufwendungen erfolgen einmal jährlich auf Grundlage der Salden zum 31. Oktober.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

6 Transaktionen mit verbundenen Unternehmen

BlueBay Funds Management Company S.A. ist die Verwaltungsgesellschaft der SICAV.

a) Verwaltungsgebühren

Die SICAV bezahlt der Verwaltungsgesellschaft eine Verwaltungsgebühr, die als Prozentsatz des täglichen Nettovermögens jeder von ihr verwalteten Klasse berechnet wird. Verwaltungsgebühren laufen an jedem Bewertungstag zu den folgenden Sätzen auf und werden monatlich rückwirkend gezahlt:

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund	B - CHF	1.00%
	B - EUR	1.00%
	B - GBP	1.00%
	B - USD	1.00%
	C - EUR	0.70%
	C - GBP	0.70%
	C - GBP (AIDiv)	0.70%
	C - USD	0.70%
	C - USD (AIDiv)	0.70%
	D - GBP (QIDiv)	1.00%
	DR - GBP (QIDiv)	1.50%
	I - EUR	1.00%
	I - NOK	1.00%
	I - USD	1.00%
	M - EUR	1.00%
	M - USD	1.00%
	Q - CHF	0.60%
	Q - EUR	0.60%
	Q - USD	0.60%
	R - EUR	1.50%
	R - EUR (AIDiv)	1.50%
	R - USD	1.50%
	R - USD (AIDiv)	1.50%
	S - EUR	0.45%
S - GBP	0.45%	
S - GBP (AIDiv)	0.45%	
S - USD	0.45%	
S - USD (AIDiv)	0.45%	

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay High Yield ESG Bond Fund	B - EUR	0.70%
	B - EUR (Perf)	0.50%
	B - GBP	0.70%
	B - USD	0.70%
	C - CHF	0.60%
	C - EUR	0.60%
	C - EUR (AIDiv)	0.60%
	C - GBP (AIDiv)	0.60%
	C - USD	0.60%
	C - USD (AIDiv)	0.60%
	D - GBP (QIDiv)	0.70%
	DR - GBP (QIDiv)	1.25%
	I - CHF	0.70%
	I - EUR	0.70%
	I - EUR (AIDiv)	0.70%

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

6 Transaktionen mit verbundenen Unternehmen (Fortsetzung)

a) Verwaltungsgebühren (Fortsetzung)

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay High Yield ESG Bond Fund (Fortsetzung)	I - EUR (Perf)	0.50%
	I - USD	0.70%
	I - USD (AIDiv)	0.70%
	I - USD (Perf)	0.50%
	M - EUR	0.70%
	M - USD	0.70%
	M - USD (MIDiv)	0.70%
	Q - EUR	0.55%
	Q - USD	0.55%
	R - CHF	1.25%
	R - EUR	1.25%
	R - EUR (AIDiv)	1.25%
	R - NOK	1.25%
	R - SEK	1.25%
	R - USD	1.25%
	R - USD (AIDiv)	1.25%
	S - CHF	0.50%
	S - EUR	0.50%
	S - EUR (AIDiv)	0.50%
	S - GBP	0.50%
	S - GBP (AIDiv)	0.50%
	S - JPY	0.50%
	S - USD	0.50%
	S - USD (AIDiv)	0.50%
	V - EUR	0.39%
	V - GBP (QIDiv)	0.39%
	V - USD	0.39%
V - USD (QIDiv)	0.39%	

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund	B - CHF	0.50%
	B - EUR	0.50%
	B - EUR (Perf)	0.30%
	B - GBP	0.50%
	B - JPY	0.50%
	B - USD	0.50%
	B - USD (Perf)	0.30%
	C - EUR	0.50%
	C - EUR (AIDiv)	0.50%
	C - GBP	0.50%
	C - GBP (AIDiv)	0.50%
	C - USD	0.50%
	C - USD (AIDiv)	0.50%
	D - GBP (QIDiv)	0.50%
	DR - GBP (QIDiv)	0.75%
	I - CHF	0.50%
	I - EUR	0.50%
	I - EUR (AIDiv)	0.50%
	I - EUR (Perf)	0.30%
	I - GBP	0.50%

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

6 Transaktionen mit verbundenen Unternehmen (Fortsetzung)

a) Verwaltungsgebühren (Fortsetzung)

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund (Fortsetzung)	I - USD	0.50%
	I - USD (Perf)	0.30%
	M - CHF	0.50%
	M - EUR	0.50%
	M - GBP	0.50%
	M - USD	0.50%
	Q - CHF	0.45%
	Q - EUR	0.45%
	Q - EUR (AIDiv)	0.45%
	Q - USD	0.45%
	R - CHF	0.75%
	R - EUR	0.75%
	R - EUR (AIDiv)	0.75%
	R - GBP	0.75%
	R - NOK	0.75%
	R - SEK	0.75%
	R - USD	0.75%
	R - USD (AIDiv)	0.75%
	S - CHF	0.40%
	S - CHF (AIDiv)	0.40%
	S - EUR	0.40%
	S - EUR (AIDiv)	0.40%
	S - GBP	0.40%
	S - GBP (AIDiv)	0.40%
	S - USD	0.40%
	S - USD (AIDiv)	0.40%

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund	B - EUR	0.60%
	B - USD	0.60%
	C - EUR	0.50%
	C - GBP (AIDiv)	0.50%
	C - USD	0.50%
	C - USD (AIDiv)	0.50%
	D - GBP (QIDiv)	0.60%
	DR - GBP (QIDiv)	1.20%
	G - USD	1.20%
	M - EUR	0.60%
	Q - CHF	0.40%
	Q - EUR	0.40%
	R - CHF	1.20%
	R - EUR	1.20%
	R - EUR (AIDiv)	1.20%
	R - SEK	1.20%
	R - USD	1.20%
	R - USD (AIDiv)	1.20%
	S - GBP (AIDiv)	0.35%
	S - USD	0.35%

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

6 Transaktionen mit verbundenen Unternehmen (Fortsetzung)

a) Verwaltungsgebühren (Fortsetzung)

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Select Bond Fund	B - EUR	0.65%
	B - USD	0.65%
	C - EUR	0.55%
	I - EUR	0.65%
	M - EUR	0.65%
	R - EUR	1.25%
	R - NOK	1.25%
	R - SEK	1.25%
	R - USD	1.25%

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund	B - CHF	1.20%
	B - EUR	1.20%
	B - USD	1.20%
	C - EUR	1.00%
	C - EUR (AIDiv)	1.00%
	C - GBP (AIDiv)	1.00%
	C - USD	1.00%
	C - USD (AIDiv)	1.00%
	DR - GBP (QIDiv)	1.50%
	I - EUR	1.20%
	I - EUR (Perf)	0.80%
	I - USD	1.20%
	I - USD (Perf)	0.80%
	M - EUR	1.20%
	Q - EUR (AIDiv)	0.80%
	Q - USD	0.80%
	R - CHF	1.50%
	R - EUR	1.50%
	R - EUR (AIDiv)	1.50%
	R - NOK	1.50%
	R - SGD (MIDiv)	1.50%
	R - USD	1.50%
	R - USD (AIDiv)	1.50%
	S - CHF	0.60%
	S - EUR	0.60%
	S - EUR (AIDiv)	0.60%
	S - GBP (AIDiv)	0.60%
S - NOK	0.60%	
S - USD	0.60%	
	S - USD (AIDiv)	0.60%

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Global Convertible Bond Fund	B - EUR	0.75%
	B - GBP	0.75%
	B - GBP (BHedged)	0.75%
	B - USD	0.75%
	B - USD (Perf)-(BHedged)	0.60%
	D - GBP (QIDiv)	0.75%
	DR - GBP (QIDiv)	1.50%

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

6 Transaktionen mit verbundenen Unternehmen (Fortsetzung)

a) Verwaltungsgebühren (Fortsetzung)

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Global Convertible Bond Fund (Fortsetzung)	I - USD	0.75%
	I - USD (Perf)	0.60%
	R - CHF	1.50%
	R - EUR	1.50%
	R - EUR (AIDiv)	1.50%
	R - USD	1.50%
	R - USD (AIDiv)	1.50%
	S - CHF (BHedged)	0.50%
S - USD	0.50%	

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund	C - EUR (QIDiv)	0.70%
	C - GBP	0.70%
	C - USD	0.70%
	C - USD (QIDiv)	0.70%
	ER - SEK	1.25%
	G - EUR (Perf)	0.70%
	I - EUR	0.95%
	I - USD	0.95%
	K - EUR	0.45%
	M - EUR	0.95%
	M - USD	0.95%
	Q - EUR	0.65%
	Q - GBP	0.65%
	Q - GBP (QIDiv)	0.65%
	Q - USD	0.65%
	R - CHF	1.50%
	R - EUR	1.50%
	R - USD	1.50%
	S - CAD (QIDiv)	0.55%
	S - EUR	0.55%
S - GBP	0.55%	
S - GBP (QIDiv)	0.55%	
S - USD	0.55%	

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund	B - EUR	0.50%
	B - USD	0.50%
	C - EUR	0.30%
	I - EUR	0.50%
	I - EUR (AIDiv)	0.50%
	I - USD	0.50%
	K - EUR	0.20%
	M - EUR	0.50%
	M - USD	0.50%
	Q - CHF	0.25%
	Q - EUR	0.25%
	Q - EUR (AIDiv)	0.25%
	Q - USD	0.25%
R - CHF	0.75%	

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

6 Transaktionen mit verbundenen Unternehmen (Fortsetzung)

a) Verwaltungsgebühren (Fortsetzung)

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund (Fortsetzung)	R - EUR	0.75%
	R - EUR (AIDiv)	0.75%
	R - GBP	0.75%
	R - USD	0.75%
	S - EUR	0.20%
	S - EUR (QIDiv)	0.20%

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund	B - CHF	0.50%
	B - EUR	0.50%
	B - USD	0.50%
	C - EUR	0.35%
	C - EUR (AIDiv)	0.35%
	I - EUR	0.50%
	I - EUR (AIDiv)	0.50%
	I - EUR (QIDiv)	0.50%
	I - USD	0.50%
	M - EUR	0.50%
	M - USD	0.50%
	Q - CHF	0.30%
	Q - EUR	0.30%
	Q - EUR (AIDiv)	0.30%
	R - EUR	0.75%
	R - EUR (AIDiv)	0.75%
	R - NOK	0.75%
	R - USD	0.75%
	S - EUR	0.25%
	S - EUR (QIDiv)	0.25%
S - JPY	0.25%	

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund	B - CHF	0.70%
	B - EUR	0.70%
	B - EUR (AIDiv)	0.70%
	B - GBP	0.70%
	B - USD	0.70%
	B - USD (AIDiv)	0.70%
	C - CHF	0.60%
	C - EUR	0.60%
	C - EUR (AIDiv)	0.60%
	C - GBP	0.60%
	C - GBP (AIDiv)	0.60%
	C - USD	0.60%
	C - USD (AIDiv)	0.60%
	D - GBP (QIDiv)	0.70%
	I - EUR	0.70%
	I - EUR (AIDiv)	0.70%
	I - EUR (Perf)	0.50%
	I - GBP	0.70%
	I - NOK	0.70%

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

6 Transaktionen mit verbundenen Unternehmen (Fortsetzung)

a) Verwaltungsgebühren (Fortsetzung)

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund (Fortsetzung)	I - SEK	0.70%
	I - USD	0.70%
	M - EUR	0.70%
	Q - CHF	0.55%
	Q - EUR	0.55%
	Q - EUR (AIDiv)	0.55%
	Q - GBP (QIDiv)	0.55%
	Q - SEK	0.55%
	Q - USD	0.55%
	Q - USD (QIDiv)	0.55%
	R - CHF	1.25%
	R - EUR	1.25%
	R - NOK	1.25%
	R - USD	1.25%
	S - EUR	0.50%
	S - GBP	0.50%
	S - GBP (AIDiv)	0.50%
	S - USD	0.50%
S - USD (QIDiv)	0.50%	

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund	B - EUR	1.00%
	I - EUR (AIDiv)	1.00%
	R - EUR	1.50%

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund	B - CHF	1.00%
	B - EUR	1.00%
	B - EUR (AIDiv)	1.00%
	B - EUR (Perf)	0.60%
	B - GBP	1.00%
	B - USD	1.00%
	C - EUR	0.80%
	C - GBP	0.80%
	C - GBP (AIDiv)	0.80%
	C - USD	0.80%
	C - USD (AIDiv)	0.80%
	D - GBP (QIDiv)	1.00%
	I - CHF	1.00%
	I - EUR	1.00%
	I - EUR (AIDiv)	1.00%
	I - EUR (Perf)	0.60%
	I - NOK	1.00%
	I - USD	1.00%
	I - USD (AIDiv)	1.00%
	K - EUR (QKDiv)	0.60%
	M - CHF	1.00%
	M - EUR	1.00%
	M - USD	1.00%
Q - CHF	0.70%	

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

6 Transaktionen mit verbundenen Unternehmen (Fortsetzung)

a) Verwaltungsgebühren (Fortsetzung)

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund (Fortsetzung)	Q - EUR	0.70%
	Q - EUR (AIDiv)	0.70%
	Q - GBP (AIDiv)	0.70%
	Q - USD	0.70%
	R - EUR	1.50%
	R - EUR (AIDiv)	1.50%
	R - USD	1.50%
	R - USD (AIDiv)	1.50%
	S - CHF	0.60%
	S - CHF (AIDiv)	0.60%
	S - EUR	0.60%
	S - GBP	0.60%
	S - GBP (AIDiv)	0.60%
	S - JPY	0.60%
	S - USD	0.60%

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund	C - EUR	1.30%
	I - EUR	1.50%
	I - NOK	1.50%
	I - USD	1.50%
	I - USD (Perf)	1.10%
	R - USD (AIDiv)	2.00%

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund	B - EUR	0.50%
	B - USD	0.50%
	C - EUR	0.45%
	C - EUR (AIDiv)	0.45%
	C - GBP	0.45%
	C - USD	0.45%
	C - USD (AIDiv)	0.45%
	I - EUR	0.50%
	I - EUR (AIDiv)	0.50%
	I - GBP	0.50%
	I - USD	0.50%
	I - USD (MIDiv)	0.50%
	M - CHF	0.50%
	M - EUR	0.50%
	M - USD	0.50%
	Q - CHF (QIDiv)	0.40%
	Q - EUR	0.40%
	Q - EUR (AIDiv)	0.40%
	Q - GBP	0.40%
	Q - GBP (QIDiv)	0.40%
	Q - USD	0.40%
	Q - USD (QIDiv)	0.40%
	R - CHF	0.75%
R - CHF (AIDiv)	0.75%	

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

6 Transaktionen mit verbundenen Unternehmen (Fortsetzung)

a) Verwaltungsgebühren (Fortsetzung)

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund (Fortsetzung)	R - CHF (QIDiv)	0.75%
	R - EUR	0.75%
	R - EUR (QIDiv)	0.75%
	R - GBP	0.75%
	R - GBP (QIDiv)	0.75%
	R - USD	0.75%
	R - USD (QIDiv)	0.75%
	S - AUD (QIDiv)	0.35%
	S - CHF	0.35%
	S - EUR	0.35%
	S - EUR (QIDiv)	0.35%
	S - GBP	0.35%
	S - GBP (QIDiv)	0.35%
	S - JPY	0.35%
	S - USD	0.35%
S - USD (QIDiv)	0.35%	

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund	B - USD	0.70%
	C - EUR	0.60%
	C - EUR (QIDiv)	0.60%
	C - GBP (QIDiv)	0.60%
	C - USD	0.60%
	C - USD (QIDiv)	0.60%
	I - AUD	0.70%
	I - EUR	0.70%
	I - GBP	0.70%
	I - GBP (QIDiv)	0.70%
	I - NOK	0.70%
	I - USD	0.70%
	M - EUR	0.70%
	M - NOK	0.70%
	S - JPY	0.45%

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Financial Capital Bond Fund	B - USD	0.80%
	C - CHF (AIDiv)	0.70%
	C - EUR	0.70%
	C - EUR (AIDiv)	0.70%
	C - GBP	0.70%
	C - GBP (AIDiv)	0.70%
	C - USD	0.70%
	C - USD (AIDiv)	0.70%
	G - EUR (AIDiv)	0.50%
	G - GBP	0.50%
	G - GBP (AIDiv)	0.50%
	G - USD (AIDiv)	0.50%
	I - EUR	0.80%
	I - GBP (AIDiv)	0.80%
	I - NOK	0.80%

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

6 Transaktionen mit verbundenen Unternehmen (Fortsetzung)

a) Verwaltungsgebühren (Fortsetzung)

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Financial Capital Bond Fund (Fortsetzung)	I - SEK	0.80%
	I - USD	0.80%
	K - CHF	0.50%
	K - EUR	0.50%
	K - GBP	0.50%
	K - GBP (AIDiv)	0.50%
	K - USD	0.50%
	K - USD (AIDiv)	0.50%
	M - CHF	0.80%
	M - EUR	0.80%
	M - EUR (AIDiv)	0.80%
	M - GBP	0.80%
	M - USD	0.80%
	M - USD (AIDiv)	0.80%
	Q - CHF	0.65%
	Q - EUR	0.65%
	Q - SEK	0.65%
	Q - USD	0.65%
	Q - USD (AIDiv)	0.65%
	R - EUR	1.30%
	R - EUR (AIDiv)	1.30%
	R - SEK	1.30%
	R - USD	1.30%
	R - USD (AIDiv)	1.30%
	S - EUR	0.60%
	S - EUR (AIDiv)	0.60%
S - GBP	0.60%	
S - USD	0.60%	

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund	C - USD (BHedged)	0.35%
	I - EUR (BHedged)	0.50%
	I - NOK (BHedged)	0.50%
	I - USD (BHedged)	0.50%
	M - EUR (AIDiv)-(BHedged)	0.50%
	M - EUR (BHedged)	0.50%
	M - NOK (BHedged)	0.50%
	Q - EUR	0.30%
	Q - JPY (BHedged)	0.30%
	R - USD	0.75%

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund	B - USD	0.70%
	I - AUD	0.70%
	I - USD	0.70%
	K - GBP	0.30%
	K - GBP (MIDiv)	0.30%
	M - EUR	0.70%
Q - EUR (QIDiv)	0.60%	

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

6 Transaktionen mit verbundenen Unternehmen (Fortsetzung)

a) Verwaltungsgebühren (Fortsetzung)

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund (Fortsetzung)	R - USD	1.30%
	S - EUR	0.55%
	S - JPY	0.55%
	S - USD	0.55%

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund	A - USD (CPerf)	1.60%
	C - EUR (CPerf)	1.00%
	C - EUR (CPerf)-(QIDiv)	1.00%
	C - GBP (CPerf)	1.00%
	C - USD (CPerf)	1.00%
	I - CAD (ACDiv)	0.95%
	I - EUR	0.95%
	I - EUR (CPerf)	1.00%
	I - EUR (Perf)	1.00%
	I - GBP (Perf)	1.00%
	I - JPY (Perf)	1.00%
	I - USD	0.95%
	I - USD (Perf)	1.00%
	M - EUR	0.95%
	M - EUR (CPerf)	1.00%
	M - USD (CPerf)	1.00%
	Q - EUR (CPerf)	1.00%
	Q - NOK (CPerf)	1.00%
	Q - SEK (CPerf)	1.00%
	S - USD (CPerf)	0.40%

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund	B - USD	0.70%
	C - EUR	0.60%
	C - GBP	0.60%
	C - GBP (AIDiv)	0.60%
	I - EUR	0.70%
	I - NOK	0.70%
	I - USD	0.70%
	K - EUR (AIDiv)	0.45%
	K - USD (AIDiv)	0.45%
	M - USD	0.70%
	Q - EUR	0.55%
	R - EUR	1.25%
	R - USD (AIDiv)	1.25%
	S - EUR	0.50%
	S - EUR (QIDiv)	0.50%
	S - GBP	0.50%
	S - GBP (QIDiv)	0.50%
	S - USD	0.50%
	S - USD (QIDiv)	0.50%

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

6 Transaktionen mit verbundenen Unternehmen (Fortsetzung)

a) Verwaltungsgebühren (Fortsetzung)

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Structured Credit Fund	G - EUR	0.15%
	G - GBP	0.15%
	G - GBP (QIDiv)	0.15%
	G - USD	0.15%
	G - USD (QIDiv)	0.15%
	I - EUR (AIDiv)	0.35%
	I - USD	0.35%
	K - EUR	0.15%
	M - EUR	0.35%
	Q - EUR	0.25%
	Q - GBP	0.25%
	Q - USD	0.25%
	S - EUR	0.20%
	S - GBP	0.20%
S - USD	0.20%	

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund	G - EUR	0.40%
	G - GBP	0.40%
	G - GBP (AIDiv)	0.40%
	G - USD	0.40%
	G - USD (MIDiv)	0.40%
	I - USD	0.60%
	K - EUR	0.40%
	K - USD	0.40%
	M - EUR	0.60%
	R - EUR	0.95%
	S - JPY	0.45%
	W - USD	0.70%

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay High Grade Structured Credit Short Duration Fund	G - EUR	0.15%
	I - EUR	0.25%
	K - EUR	0.15%
	K - USD	0.15%

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade ESG Bond Fund	I - EUR	0.50%
	S - EUR	0.40%

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Impact-Aligned Bond Fund	C - GBP	0.40%
	C - GBP (QIDiv)	0.40%
	G - EUR	0.25%
	G - EUR (QIDiv)	0.25%
	G - GBP	0.25%
	G - GBP (QIDiv)	0.25%
	G - USD	0.25%
	I - USD	0.50%

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

6 Transaktionen mit verbundenen Unternehmen (Fortsetzung)

a) Verwaltungsgebühren (Fortsetzung)

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Impact-Aligned Bond Fund (Fortsetzung)	K - CHF	0.25%
	K - EUR	0.25%
	K - GBP	0.25%
	K - USD	0.25%
	R - CHF	0.75%
	S - GBP	0.30%
	S - GBP (QIDiv)	0.30%

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Government Bond Fund	I - EUR	0.50%
	Q - GBP	0.25%
	Q - GBP (QIDiv)	0.25%
	S - CHF	0.20%
	S - EUR	0.20%
	S - EUR (AIDiv)	0.20%
	S - GBP	0.20%
	S - GBP (AIDiv)	0.20%
	S - USD	0.20%
	S - USD (AIDiv)	0.20%

Teilfonds	Aktienklasse*	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Financials Plus Bond Fund	C - GBP	0.45%
	C - GBP (QCDiv)	0.45%
	I - USD	0.50%
	S - GBP	0.35%
	S - GBP (QIDiv)	0.35%

* Einzelheiten zu den Daten, an denen die Aktienklassen im Laufe des Berichtszeitraums aufgelegt oder geschlossen wurden, entnehmen Sie bitte Anhang 1.

Für Aktien der Klasse X, Y, Z oder ZR fallen keine Verwaltungsgebühren an.

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

6 Transaktionen mit verbundenen Unternehmen (Fortsetzung)

b) Performancegebühren

Für jeden Teilfonds können zwei Mechanismen für Performancegebühren angewendet werden, nämlich „angeglichene“ Performancegebühren und „nicht angegliche“ Performancegebühren. Nach beiden Grundsätzen kann die Verwaltungsgesellschaft Anspruch auf eine Performancegebühr aus dem Nettovermögen der jeweiligen Aktienklasse haben. Die Berechnungsmethode unterscheidet sich nach den beiden unterschiedlichen Mechanismen wie nachfolgend beschrieben.

Die Performancegebühr läuft an jedem Bewertungstag auf. Die für jede eine Performancegebühr zahlende Aktienklasse effektiv fällig und zahlbar werdende Performancegebühr wird am letzten Bewertungstag im Oktober (dem „Kristallisationstag“) festgelegt.

In jedem Berechnungszeitraum entspricht die Performancegebühr für jeden Aktienbesitz einem im Verkaufsprospekt festgelegten Prozentsatz der Wertsteigerung der kumulativen relativen Performance je Aktie während dieses Berechnungszeitraums, sofern die kumulative relative Performance positiv ist. Die Performancegebühr wird auf Ebene der Aktienklasse berechnet und vom Teilfonds an die Verwaltungsgesellschaft gezahlt.

An jedem Kristallisationstag, an dem eine Performancegebühr zu zahlen ist, wird die kumulative relative Performance je Aktie auf null zurückgesetzt, gegebenenfalls durch Neuausrichtung des Index auf den Nettoinventarwert je Aktie und gegebenenfalls durch Zurücksetzen der Zeichnungsanpassung zum betreffenden Kristallisationstag.

Eine Performancegebühr wird nur für einen Berechnungszeitraum fällig, wenn die ggf. um den Wert der Zeichnungsanpassung angepasste kumulative relative Performance am Ende des Kristallisationstages, der das Ende eines solchen Berechnungszeitraums markiert, positiv ist.

Der Anstieg des relativen Werts des Aktienbesitzes bemisst sich nach der kumulativen relativen Performance, die sich aus der kumulierten Rendite je Aktie abzüglich der kumulierten Rendite der jeweiligen Benchmark oder der Hurdle Rate ergibt. Die für die Berechnung der Performancegebühr gegebenenfalls maßgeblichen Benchmarks oder Hurdle Rates können zwischen den Teilfonds und Aktienklassen variieren und sind im Prospekt angegeben.

Wenn für einen Berechnungszeitraum keine Performancegebühr gezahlt wird, wird die Ermittlung der kumulativen relativen Performance fortgesetzt, ohne die kumulative relative Performance und gegebenenfalls die Zeichnungsanpassung zurückzusetzen, bis an einem Kristallisationstag eine positive kumulative relative Performance vorliegt.

Die Performancegebühr wird der Verwaltungsgesellschaft in der Regel nach Ende jedes Berechnungszeitraums rückwirkend gezahlt. Bei Aktien, die während des Berechnungszeitraums zurückgenommen wurden, ist die aufgelaufene Performancegebühr für diese Aktien nach dem Rücknahmedatum zu zahlen. Bei einer teilweisen Rücknahme während oder am Ende eines Berechnungszeitraums werden die Aktien so behandelt, als wäre ihre Rücknahme aus dem Aktienbestand des betreffenden Aktionärs erfolgt.

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

6 Transaktionen mit verbundenen Unternehmen (Fortsetzung)

b) Performancegebühren (Fortsetzung)

Wird der Dienstleistungsvertrag mit der Verwaltungsgesellschaft vor Ablauf eines Berechnungszeitraums beendet, wird die Performancegebühr für den gerade laufenden Berechnungszeitraum so berechnet und ausgezahlt, als ob das Datum der Beendigung des Vertrages mit dem Ende des entsprechenden Berechnungszeitraums zusammenfallen würde.

• **Angegliche Performancegebühren**

Bei den mit dem Zusatz „(Perf)“ gekennzeichneten Aktienklassen, die eine Performancegebühr zahlen, hat die Verwaltungsgesellschaft Anspruch auf eine Performancegebühr, die auf der Ebene der einzelnen Aktionäre unter Verwendung einer Berechnungsmethode für eine angegliche Performancegebühr berechnet wird. Diese Berechnungsmethode gewährleistet, dass (i) die der Verwaltungsgesellschaft geschuldete Performancegebühr stets nur für diejenigen Aktienbestände anfällt, die eine relative Wertsteigerung aufweisen; (ii) alle Aktionäre denselben Risikokapitaleinsatz pro Aktie im Teilfonds halten; und (iii) alle Aktien der betreffenden Klasse denselben Nettoinventarwert pro Aktie haben.

Wenn ein Aktionär Aktien zu einem anderen Zeitpunkt als an einem Kristallisationstag zeichnet, werden bestimmte Anpassungen vorgenommen, um die Ungleichgewichte zu verringern, die ansonsten für den Aktionär oder die Verwaltungsgesellschaft entstehen könnten.

• **Nicht angegliche Performancegebühren**

Bei den mit dem Zusatz „(CPerf)“ gekennzeichneten Aktienklassen, die eine Performancegebühr zahlen, hat die Verwaltungsgesellschaft Anspruch auf eine Performancegebühr, die auf der Ebene der Aktienklasse unter Verwendung einer Berechnungsmethode für eine nicht angegliche Performancegebühr berechnet wird. Diese Berechnungsmethode wendet keine Form von Angleichung der Performancegebühr auf der Ebene des einzelnen Aktionärs an, und es gibt im Zusammenhang mit der Aktienklasse keine Ausgleichbelastungen oder Ausgleichsgutschriften. Für diese Klassen wird jedoch ein spezifischer Mechanismus angewendet (die „Zeichnungsanpassung“), der darin besteht, dass aus der Rückstellung für die auf der Grundlage der Anzahl der im Umlauf befindlichen Aktien berechnete Performancegebühr die Performancegebühr herausgenommen wird, die sich auf die Aktien bezieht, die im Zeitraum vor dem Zeichnungsdatum gezeichnet wurden. Somit wird für diese neu gezeichneten Aktien keine Performancegebühr für die Performance vor dem Zeichnungsdatum vorgesehen.

Eine der Verwaltungsgesellschaft geschuldete Performancegebühr fällt an, wenn der relative Wert der Klasse gestiegen ist.

Die der Klasse täglich belastete Performancegebühr wird durch Multiplikation der kumulativen relativen Performance, sofern diese positiv ist, mit der Anzahl der Aktien der Klasse an dem betreffenden Tag ermittelt. Dieser Wert wird dann mit dem im Prospekt angegebenen anwendbaren Satz der Performancegebühr multipliziert und mit dem Wert der Zeichnungsanpassung für diesen Tag angepasst.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

6 Transaktionen mit verbundenen Unternehmen (Fortsetzung)

b) Performancegebühren (Fortsetzung)

Im Berichtszeitraum wurden die folgenden Performancegebühren als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens der jeweiligen Aktienklassen belastet:

Teilfonds	Aktienklasse*	Währung	Performancegebühren	Satz
BlueBay Funds – BlueBay High Yield ESG Bond Fund	B - EUR (Perf)	EUR	–	0.00%
	I - EUR (Perf)	EUR	–	0.00%
	I - USD (Perf)	EUR	–	0.00%

Teilfonds	Aktienklasse*	Währung	Performancegebühren	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund	B - EUR (Perf)	EUR	423	0.23%
	B - USD (Perf)	EUR	48	0.04%
	I - EUR (Perf)	EUR	172,826	0.26%
	I - USD (Perf)	EUR	5,694	0.13%

Teilfonds	Aktienklasse*	Währung	Performancegebühren	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund	I - EUR (Perf)	USD	–	0.00%
	I - USD (Perf)	USD	–	0.00%

Teilfonds	Aktienklasse*	Währung	Performancegebühren	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Global Convertible Bond Fund	B - USD (Perf)- (BHedged)	USD	–	0.00%
	I - USD (Perf)	USD	–	0.00%

Teilfonds	Aktienklasse*	Währung	Performancegebühren	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund	G - EUR (Perf)	USD	–	0.00%

Teilfonds	Aktienklasse*	Währung	Performancegebühren	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund	I - EUR (Perf)	USD	–	0.00%

Teilfonds	Aktienklasse*	Währung	Performancegebühren	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund	B - EUR (Perf)	EUR	2,044	0.75%
	I - EUR (Perf)	EUR	113	0.83%

Teilfonds	Aktienklasse*	Währung	Performancegebühren	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund	I - USD (Perf)	USD	–	0.00%

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

6 Transaktionen mit verbundenen Unternehmen (Fortsetzung)

b) Performancegebühren (Fortsetzung)

Teilfonds	Aktienklasse*	Währung	Performancegebühren	Satz
BlueBay Funds – BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund	A - USD (CPerf)	USD	131	2.44%
	C - EUR (CPerf)	USD	42,556	1.28%
	C - EUR (CPerf)-(QIDiv)	USD	1,673	1.87%
	C - GBP (CPerf)	USD	39,448	1.94%
	C - USD (CPerf)	USD	15,136	0.78%
	I - EUR (CPerf)	USD	60,838	1.15%
	I - EUR (Perf)	USD	418,981	2.09%
	I - GBP (Perf)	USD	43,127	1.23%
	I - JPY (Perf)	USD	–	0.00%
	I - USD (Perf)	USD	604,244	3.57%
	M - EUR (CPerf)	USD	159,507	1.30%
	M - USD (CPerf)	USD	166	2.01%
	Q - EUR (CPerf)	USD	354,196	1.61%
	Q - NOK (CPerf)	USD	54,347	2.16%
	Q - SEK (CPerf)	USD	902,743	1.84%
	S - USD (CPerf)	USD	1,586	3.85%
	ZR - EUR (CPerf)	USD	288,603	4.43%
	ZR - GBP (CPerf)-(AIDiv)	USD	60,453	1.47%
	ZR - USD (CPerf)-(AIDiv)	USD	20,461	7.86%

* Einzelheiten zu den Daten, an denen die Aktienklassen im Laufe des Berichtszeitraums aufgelegt oder geschlossen wurden, entnehmen Sie bitte Anhang 1.

Die zum 31. Dezember 2023 zu zahlenden Performancegebühren sind in der Nettovermögensaufstellung unter dem Titel „Verbindlichkeiten aus Performancegebühren“ enthalten.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

7 Verwaltungsrat und Honorar des Verwaltungsrats

Constantine Knox und Neil Sills sind leitende Angestellte des Anlageverwalters und Berater der SICAV und haben auf ihren Anspruch auf das Honorar für Verwaltungsratsmitglieder der SICAV verzichtet.

Henry Kelly, William Jones, Luigi Passamonti, Nicholas Williams und Tracey McDermott erhalten als Mitglieder des Verwaltungsrats der SICAV ein jährliches Honorar in Höhe von EUR 45,000 pro Verwaltungsratsmitglied.

Nicholas Williams erhält für die Erfüllung seiner Aufgaben als ständiger Vorsitzender der Gesellschaft eine zusätzliche Vergütung in Höhe von EUR 5,000. William Jones erhielt für die Erfüllung seiner Aufgaben als Kontaktperson bei der Bekämpfung von Geldwäsche und Terrorismusfinanzierung für den Verwaltungsrat der Gesellschaft eine Vergütung in Höhe von EUR 13,245.

8 Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Zur effizienten Portfolioverwaltung setzt die SICAV Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte ein. Die dadurch ggf. anfallenden Erträge und Aufwendungen werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens unter Zinserträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften und Zinsaufwendungen aus Pensionsgeschäften angeführt (Seiten 203–212).

Zum 31. Dezember 2023 hatte die SICAV keine offenen Pensionsgeschäfte oder umgekehrten Pensionsgeschäfte.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen

Alle Teilfonds können zu Anlage- und Absicherungszwecken sowie für ein effizientes Portfoliomanagement Finanztechniken und -instrumente einsetzen. Zu diesen Portfoliostrategien zählen auch Geschäfte mit Finanzterminkontrakten und Optionen auf Finanzterminterminkontrakte. Die Teilfonds können ferner in Optionen auf Schuldverschreibungen, Aktienindizes und Indexanlagen investieren. Die Teilfonds können ihre Anlagen gegen Wechselkursschwankungen absichern, die für die jeweiligen Währungen, auf die diese Teilfonds lauten, ungünstig sind, indem sie Optionen auf Devisen, Finanzterminkontrakte und Devisenterminkontrakte abschließen.

Die Teilfonds können Zinsterminkontrakte verkaufen, Kaufoptionen abschließen, Verkaufsoptionen auf Zinssätze erwerben oder Swapgeschäfte mit dem Ziel abschließen, sich gegen Zinsschwankungen abzusichern. Die Teilfonds können liquide Zusatzvermögen halten, die der Anlageverwalter als angemessen erachtet, und zwar u. a. in Form von Barmitteln, barmittelähnlichen Anlagen und Anlagen in Verbindung mit Pensionsgeschäften im Rahmen einer Treasury-Management-Strategie. Jeder Teilfonds kann ferner im Einklang mit den Bestimmungen der CSSF-Rundschreiben 08/356, CSSF 13/559 und CSSF 11/512 Wertpapierleihgeschäfte eingehen und Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließen.

Die Arten von Derivategeschäften, die jeder Teilfonds eingehen kann, werden im Anhang zum Verkaufsprospekt detailliert beschrieben. Die folgenden Tabellen zeigen die derivativen Finanzinstrumente, die jeder Teilfonds zum Ende des Berichtszeitraums hält.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte

Zum 31. Dezember 2023 bestanden bei der SICAV die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
USD	31,249,016	EUR	(29,195,858)	18/01/24	(1,022,262)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(1,022,262)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
NOK	929,825,765	USD	(87,827,882)	I - NOK	08/01/24	3,740,953
EUR	97,190,096	USD	(106,057,002)	S - EUR	08/01/24	1,324,573
CHF	27,512,965	USD	(31,814,266)	B - CHF	08/01/24	892,112
CHF	14,659,815	USD	(16,949,017)	Q - CHF	08/01/24	478,018
EUR	26,044,627	USD	(28,371,710)	M - EUR	08/01/24	403,991
EUR	10,566,311	USD	(11,512,506)	I - EUR	08/01/24	161,802
EUR	4,166,798	USD	(4,540,068)	C - EUR	08/01/24	63,666
EUR	3,478,649	USD	(3,790,267)	R - EUR	08/01/24	53,157
EUR	1,677,244	USD	(1,827,492)	R - EUR (AIDiv)	08/01/24	25,631
EUR	1,575,911	USD	(1,717,083)	B - EUR	08/01/24	24,080
GBP	2,155,302	USD	(2,729,440)	S - GBP (AIDiv)	08/01/24	18,211
EUR	1,451,955	USD	(1,594,515)	Q - EUR	08/01/24	9,694
GBP	912,603	USD	(1,155,759)	C - GBP	08/01/24	7,658
GBP	537,330	USD	(680,499)	DR - GBP (QIDiv)	08/01/24	4,508
GBP	282,936	USD	(358,323)	B - GBP	08/01/24	2,374
GBP	251,933	USD	(319,059)	S - GBP	08/01/24	2,113
GBP	32,251	USD	(40,845)	D - GBP (QIDiv)	08/01/24	270
USD	9,197	EUR	(8,278)	I - EUR	08/01/24	51
GBP	2,054	USD	(2,586)	C - GBP (AIDiv)	08/01/24	32
USD	1,353	CHF	(1,131)	Q - CHF	08/01/24	9
USD	56	EUR	(50)	S - EUR	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					7,212,903	

USD	42,983,760	NOK	(469,697,381)	I - NOK	08/01/24	(3,271,834)
USD	52,943,280	EUR	(48,884,307)	S - EUR	08/01/24	(1,067,099)
USD	15,731,603	CHF	(13,713,891)	B - CHF	08/01/24	(570,955)
USD	14,791,084	EUR	(13,692,758)	M - EUR	08/01/24	(337,513)
USD	8,428,570	CHF	(7,349,116)	Q - CHF	08/01/24	(307,781)
USD	5,759,151	EUR	(5,333,785)	I - EUR	08/01/24	(133,942)
USD	2,262,765	EUR	(2,095,650)	C - EUR	08/01/24	(52,637)
USD	1,889,192	EUR	(1,749,671)	R - EUR	08/01/24	(43,951)
USD	910,881	EUR	(843,611)	R - EUR (AIDiv)	08/01/24	(21,191)
USD	855,814	EUR	(792,609)	B - EUR	08/01/24	(19,909)
USD	1,262,106	GBP	(1,002,554)	S - GBP (AIDiv)	08/01/24	(15,984)
USD	574,791	GBP	(456,586)	C - GBP	08/01/24	(7,280)
USD	338,452	GBP	(268,849)	DR - GBP (QIDiv)	08/01/24	(4,285)
USD	178,208	GBP	(141,559)	B - GBP	08/01/24	(2,256)
USD	158,673	GBP	(126,042)	S - GBP	08/01/24	(2,010)
EUR	154,342	USD	(171,476)	S - EUR	08/01/24	(949)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
USD	20,314	GBP	(16,136)	D - GBP (QIDiv)	08/01/24	(257)
EUR	197	USD	(218)	Q - EUR	08/01/24	(1)
USD	20	GBP	(16)	C - GBP (AIDiv)	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(5,859,834)

BlueBay Funds – BlueBay High Yield ESG Bond Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) EUR
EUR	6,992,319	USD	(7,467,490)	18/01/24	236,476
EUR	7,873,433	GBP	(6,784,901)	18/01/24	47,640
EUR	191	USD	(211)	08/01/24	0
EUR	304	GBP	(264)	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					284,116
EUR	43,686,260	GBP	(37,939,691)	18/01/24	(73,880)
GBP	20,165	EUR	(23,280)	08/01/24	(12)
USD	211	EUR	(191)	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(73,892)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) EUR
JPY	1,873,791,119	EUR	(11,825,614)	S - JPY	09/01/24	215,038
NOK	30,117,458	EUR	(2,554,026)	R - NOK	08/01/24	130,432
SEK	71,074,289	EUR	(6,284,781)	R - SEK	08/01/24	99,657
CHF	1,068,058	EUR	(1,134,317)	R - CHF	08/01/24	14,847
EUR	633,378	USD	(684,462)	I - USD	08/01/24	13,878
EUR	409,355	USD	(442,317)	R - USD	08/01/24	9,018
CHF	341,360	EUR	(362,536)	C - CHF	08/01/24	4,746
CHF	180,374	EUR	(191,563)	S - CHF	08/01/24	2,507
EUR	110,565	USD	(119,468)	B - USD	08/01/24	2,436
EUR	48,781	USD	(52,710)	R - USD (AIDiv)	08/01/24	1,074
CHF	62,701	EUR	(66,590)	I - CHF	08/01/24	872
EUR	227,580	USD	(250,524)	I - USD (Perf)	08/01/24	832
EUR	26,155	USD	(28,261)	C - USD	08/01/24	576
EUR	18,220	USD	(19,660)	Q - USD	08/01/24	426
EUR	211,347	SEK	(2,348,547)	R - SEK	08/01/24	381
EUR	7,402	USD	(7,998)	I - USD (AIDiv)	08/01/24	163
EUR	3,470	USD	(3,750)	C - USD (AIDiv)	08/01/24	76

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay High Yield ESG Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) EUR
EUR	1,929	USD	(2,084)	S - USD	08/01/24	42
EUR	2,399	GBP	(2,056)	DR - GBP (QIDiv)	08/01/24	27
EUR	72	USD	(78)	M - USD	08/01/24	2
EUR	72	USD	(78)	V - USD	08/01/24	2
EUR	76	USD	(82)	S - USD (AIDiv)	08/01/24	2
EUR	76	USD	(82)	M - USD (MIDiv)	08/01/24	2
EUR	72	USD	(78)	V - USD (QIDiv)	08/01/24	2

Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt

497,038

USD	41,474,897	EUR	(38,406,634)	R - USD	08/01/24	(868,069)
USD	16,398,220	EUR	(15,187,209)	B - USD	08/01/24	(345,324)
USD	5,757,332	EUR	(5,332,296)	I - USD	08/01/24	(121,386)
USD	4,964,025	EUR	(4,597,447)	R - USD (AIDiv)	08/01/24	(104,553)
USD	3,891,788	EUR	(3,604,377)	C - USD	08/01/24	(81,953)
USD	1,755,647	EUR	(1,625,991)	I - USD (Perf)	08/01/24	(36,970)
USD	1,103,291	EUR	(1,021,813)	I - USD (AIDiv)	08/01/24	(23,234)
USD	991,799	EUR	(918,513)	Q - USD	08/01/24	(20,844)
GBP	907,267	EUR	(1,058,427)	DR - GBP (QIDiv)	08/01/24	(11,585)
USD	517,386	EUR	(479,176)	C - USD (AIDiv)	08/01/24	(10,895)
USD	287,659	EUR	(266,415)	S - USD	08/01/24	(6,058)
GBP	379,253	EUR	(442,439)	D - GBP (QIDiv)	08/01/24	(4,842)
GBP	279,409	EUR	(325,960)	S - GBP (AIDiv)	08/01/24	(3,567)
GBP	207,987	EUR	(242,639)	S - GBP	08/01/24	(2,656)
GBP	94,538	EUR	(110,289)	C - GBP (AIDiv)	08/01/24	(1,208)
JPY	20,661,448	EUR	(133,921)	S - JPY	09/01/24	(1,154)
EUR	62,856	SEK	(706,549)	R - SEK	08/01/24	(612)
GBP	49,715	EUR	(57,972)	B - GBP	08/01/24	(608)
SEK	396,751	EUR	(35,950)	R - SEK	08/01/24	(310)
USD	12,145	EUR	(11,248)	M - USD (MIDiv)	08/01/24	(255)
USD	12,147	EUR	(11,250)	S - USD (AIDiv)	08/01/24	(255)
USD	10,797	EUR	(9,999)	V - USD	08/01/24	(227)
USD	10,789	EUR	(9,992)	M - USD	08/01/24	(227)
USD	10,797	EUR	(9,999)	V - USD (QIDiv)	08/01/24	(227)
GBP	17,225	EUR	(20,095)	V - GBP (QIDiv)	08/01/24	(220)

Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt

(1,647,239)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) EUR
EUR	317,369,028	USD	(337,305,780)	18/01/24	12,208,271
GBP	17,690,000	EUR	(20,273,931)	18/01/24	129,948
EUR	6,721,198	GBP	(5,771,572)	18/01/24	64,191

Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt

12,402,410

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) EUR
USD	16,700,000	EUR	(15,358,794)	18/01/24	(250,293)
EUR	121,573,843	GBP	(105,523,968)	18/01/24	(138,893)
GBP	45,880	EUR	(52,966)	08/01/24	(27)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(389,213)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) EUR
NOK	400,730,696	EUR	(34,028,731)	R - NOK	08/01/24	1,689,576
SEK	282,356,978	EUR	(24,966,986)	R - SEK	08/01/24	396,488
CHF	7,252,416	EUR	(7,699,800)	S - CHF	08/01/24	103,348
CHF	7,044,362	EUR	(7,478,636)	S - CHF (AIDiv)	08/01/24	100,657
CHF	3,046,555	EUR	(3,234,424)	R - CHF	08/01/24	43,479
CHF	2,956,119	EUR	(3,138,315)	Q - CHF	08/01/24	42,283
CHF	2,696,477	EUR	(2,863,817)	B - CHF	08/01/24	37,424
EUR	560,708	USD	(606,505)	I - USD	08/01/24	11,766
CHF	792,106	EUR	(840,943)	I - CHF	08/01/24	11,312
EUR	506,062	USD	(546,815)	C - USD	08/01/24	11,145
JPY	68,481,047	EUR	(432,169)	B - JPY	09/01/24	7,878
EUR	293,382	USD	(318,474)	R - USD	08/01/24	5,134
EUR	139,801	USD	(151,059)	C - USD (AIDiv)	08/01/24	3,079
EUR	111,142	USD	(120,092)	B - USD	08/01/24	2,448
EUR	74,353	USD	(80,340)	I - USD (Perf)	08/01/24	1,638
EUR	68,055	USD	(73,534)	R - USD (AIDiv)	08/01/24	1,499
CHF	98,003	EUR	(104,085)	M - CHF	08/01/24	1,361
EUR	43,232	USD	(46,816)	S - USD	08/01/24	859
EUR	92,414	GBP	(79,492)	B - GBP	08/01/24	694
EUR	40,496	GBP	(34,757)	D - GBP (QIDiv)	08/01/24	392
EUR	14,211	USD	(15,357)	Q - USD	08/01/24	311
EUR	122,064	SEK	(1,355,887)	R - SEK	08/01/24	268
GBP	48,908	EUR	(56,305)	I - GBP	08/01/24	126
GBP	40,165	EUR	(46,241)	C - GBP (AIDiv)	08/01/24	104
GBP	16,548	EUR	(19,051)	D - GBP (QIDiv)	08/01/24	43
EUR	1,897	USD	(2,050)	B - USD (Perf)	08/01/24	42
GBP	14,340	EUR	(16,508)	DR - GBP (QIDiv)	08/01/24	37
GBP	12,005	EUR	(13,821)	B - GBP	08/01/24	31
GBP	12,154	EUR	(13,992)	S - GBP (AIDiv)	08/01/24	31
EUR	1,399	USD	(1,513)	S - USD (AIDiv)	08/01/24	30
GBP	11,162	EUR	(12,851)	C - GBP	08/01/24	29
GBP	11,162	EUR	(12,850)	S - GBP	08/01/24	29
EUR	852	USD	(920)	M - USD	08/01/24	19
EUR	99,141	GBP	(85,909)	S - GBP	08/01/24	16
GBP	5,129	EUR	(5,905)	R - GBP	08/01/24	13
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						2,473,589
USD	79,342,026	EUR	(73,477,175)	I - USD	08/01/24	(1,665,403)
USD	75,594,683	EUR	(70,010,902)	C - USD	08/01/24	(1,590,818)
USD	34,359,389	EUR	(31,823,200)	R - USD	08/01/24	(724,819)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
USD	22,231,225	EUR	(20,588,073)	C - USD (AIDiv)	08/01/24	(466,787)
USD	11,073,019	EUR	(10,255,451)	I - USD (Perf)	08/01/24	(233,358)
USD	10,144,038	EUR	(9,395,270)	R - USD (AIDiv)	08/01/24	(213,991)
USD	9,349,944	EUR	(8,659,812)	B - USD	08/01/24	(197,260)
USD	7,331,663	EUR	(6,772,139)	S - USD	08/01/24	(136,314)
EUR	19,475,207	USD	(21,637,267)	C - USD	08/01/24	(108,494)
GBP	7,753,263	EUR	(9,045,888)	I - GBP	08/01/24	(99,860)
GBP	6,374,068	EUR	(7,436,746)	C - GBP (AIDiv)	08/01/24	(82,089)
USD	3,565,294	EUR	(3,279,314)	Q - USD	08/01/24	(52,397)
EUR	847,018	NOK	(10,002,071)	R - NOK	08/01/24	(44,496)
USD	1,858,161	EUR	(1,717,265)	S - USD (AIDiv)	08/01/24	(35,460)
GBP	2,664,264	EUR	(3,108,452)	D - GBP (QIDiv)	08/01/24	(34,317)
GBP	2,293,772	EUR	(2,676,191)	DR - GBP (QIDiv)	08/01/24	(29,544)
GBP	1,947,867	EUR	(2,272,617)	B - GBP	08/01/24	(25,088)
GBP	1,923,655	EUR	(2,244,367)	S - GBP (AIDiv)	08/01/24	(24,777)
GBP	1,771,413	EUR	(2,066,744)	C - GBP	08/01/24	(22,816)
GBP	1,766,684	EUR	(2,061,226)	S - GBP	08/01/24	(22,756)
GBP	820,485	EUR	(957,277)	R - GBP	08/01/24	(10,568)
USD	282,991	EUR	(262,103)	B - USD (Perf)	08/01/24	(5,970)
EUR	430,344	SEK	(4,834,657)	R - SEK	08/01/24	(3,940)
USD	127,081	EUR	(117,700)	M - USD	08/01/24	(2,680)
EUR	118,150	CHF	(111,783)	S - CHF	08/01/24	(2,121)
EUR	61,269	CHF	(57,832)	I - CHF	08/01/24	(954)
EUR	44,126	CHF	(41,869)	B - CHF	08/01/24	(921)
EUR	40,856	CHF	(38,576)	R - CHF	08/01/24	(649)
SEK	1,872,087	EUR	(168,540)	R - SEK	08/01/24	(374)
EUR	91,006	GBP	(79,078)	S - GBP	08/01/24	(237)
JPY	703,533	EUR	(4,560)	B - JPY	09/01/24	(39)
EUR	907	USD	(1,007)	B - USD	08/01/24	(5)
EUR	258	CHF	(244)	S - CHF (AIDiv)	08/01/24	(5)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(5,839,307)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
COP	6,944,422,835	USD	(1,595,405)	18/01/24	191,401
THB	69,640,546	USD	(1,911,088)	18/01/24	132,010
GBP	1,958,168	USD	(2,400,000)	18/01/24	96,492
MXN	27,025,642	USD	(1,500,487)	18/01/24	91,254
PLN	3,306,102	USD	(763,814)	18/01/24	76,777
CLP	1,284,090,740	USD	(1,400,118)	18/01/24	69,165
NOK	20,368,178	EUR	(1,753,749)	18/01/24	67,916
PLN	5,944,463	EUR	(1,307,691)	18/01/24	65,968
CZK	34,039,865	USD	(1,461,921)	18/01/24	60,373
PEN	7,471,321	USD	(1,965,845)	18/01/24	51,031
EUR	1,190,286	USD	(1,267,686)	18/01/24	47,982
ZAR	36,052,901	USD	(1,924,694)	18/01/24	44,129
MYR	11,364,245	USD	(2,438,262)	18/01/24	41,959

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
KRW	1,999,223,517	USD	(1,500,821)	18/01/24	41,857
JPY	141,831,806	USD	(967,207)	18/01/24	41,262
CAD	1,411,914	USD	(1,030,000)	18/01/24	41,010
CNY	11,532,738	USD	(1,590,076)	18/01/24	39,083
IDR	25,368,913,490	USD	(1,612,753)	18/01/24	32,804
HUF	301,392,489	USD	(840,204)	18/01/24	28,918
BRL	4,100,530	USD	(815,660)	02/02/24	27,021
TWD	24,774,122	USD	(790,000)	18/01/24	23,727
RON	3,220,501	USD	(701,950)	18/01/24	13,022
MYR	3,366,235	USD	(723,459)	18/01/24	11,214
KZT	56,037,152	USD	(114,328)	18/01/24	8,004
CNY	1,675,054	USD	(230,000)	17/01/24	6,620
HUF	71,118,826	EUR	(180,000)	17/01/24	6,164
USD	690,000	KRW	(890,415,970)	18/01/24	2,921
INR	169,267,440	USD	(2,030,000)	18/01/24	2,635
HUF	303,615,775	EUR	(790,000)	18/01/24	2,317
TRY	8,703,639	USD	(290,000)	18/01/24	703
EUR	660,000	HUF	(252,814,860)	18/01/24	482
USD	29,295	CLP	(25,248,189)	18/01/24	405
CHF	17,204	EUR	(18,224)	18/01/24	330
USD	350,000	HUF	(121,310,733)	18/01/24	177
EUR	36,072	PLN	(156,779)	18/01/24	10
RON	118,001	EUR	(23,697)	18/01/24	4

Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt

1,367,147

USD	3,981,364	COP	(16,845,137,628)	18/01/24	(352,909)
USD	1,484,633	MXN	(26,907,027)	18/01/24	(100,127)
USD	2,403,364	GBP	(1,963,231)	18/01/24	(99,584)
USD	2,005,926	ZAR	(37,811,818)	18/01/24	(58,949)
USD	1,320,000	CLP	(1,203,051,509)	18/01/24	(56,555)
USD	2,348,420	PEN	(8,908,647)	18/01/24	(56,462)
USD	1,285,759	EUR	(1,212,355)	18/01/24	(54,302)
EUR	1,547,360	HUF	(611,162,369)	18/01/24	(52,048)
EUR	1,390,000	NOK	(16,065,777)	18/01/24	(46,166)
USD	961,344	THB	(34,315,626)	18/01/24	(45,399)
USD	1,764,028	CNY	(12,792,637)	18/01/24	(43,108)
USD	1,030,000	CAD	(1,413,161)	18/01/24	(41,957)
EUR	1,270,000	PLN	(5,637,669)	18/01/24	(29,623)
USD	821,815	CZK	(19,027,334)	18/01/24	(29,103)
USD	1,875,348	IDR	(29,187,937,836)	18/01/24	(17,933)
USD	898,917	RON	(4,125,720)	18/01/24	(17,019)
USD	279,612	JPY	(41,495,510)	18/01/24	(15,434)
EGP	8,007,000	USD	(170,000)	10/12/24	(12,494)
USD	585,591	MYR	(2,733,426)	18/01/24	(10,973)
USD	651,705	MYR	(3,033,727)	18/01/24	(10,398)
USD	605,940	HUF	(213,699,680)	18/01/24	(10,303)
USD	210,000	CZK	(4,922,867)	17/01/24	(10,163)
USD	417,983	KRW	(554,415,562)	18/01/24	(9,825)
USD	2,240,000	INR	(187,334,869)	18/01/24	(9,595)
EUR	470,000	CHF	(444,415)	18/01/24	(9,381)
USD	350,000	TWD	(10,889,396)	18/01/24	(7,672)
USD	108,889	PLN	(448,414)	18/01/24	(5,123)
USD	224,172	CRC	(119,394,000)	18/01/24	(4,882)
USD	50,000	KZT	(24,625,000)	18/01/24	(3,758)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
KRW	493,281,336	USD	(383,454)	18/01/24	(2,819)
USD	199,592	BRL	(982,066)	02/02/24	(2,228)
USD	121,577	TRY	(3,702,015)	18/01/24	(2,071)
EUR	80,000	NOK	(915,566)	17/01/24	(1,764)
HUF	77,766,176	EUR	(204,243)	18/01/24	(1,504)
COP	343,480,008	USD	(89,876)	18/01/24	(1,498)
PLN	149,080	USD	(38,251)	18/01/24	(347)
CZK	839,863	USD	(37,800)	17/01/24	(239)
HUF	13,794,129	USD	(40,001)	18/01/24	(223)
NOK	2,242,008	EUR	(200,000)	18/01/24	(215)
USD	3,350	AUD	(5,208)	18/01/24	(205)
INR	18,309,720	USD	(220,000)	18/01/24	(129)
CNY	374,297	USD	(52,991)	18/01/24	(116)
MYR	158,934	USD	(34,793)	18/01/24	(106)
EUR	24,301	RON	(121,431)	18/01/24	(97)
BRL	221,670	USD	(45,646)	02/02/24	(92)
IDR	2,086,971,135	USD	(135,441)	18/01/24	(69)
CZK	880,245	USD	(39,432)	18/01/24	(67)
CZK	486,594	EUR	(19,716)	18/01/24	(32)
ZAR	778,747	USD	(42,552)	18/01/24	(26)
GBP	1,155	USD	(1,472)	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(1,235,092)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
SEK	119,079,795	USD	(11,375,065)	R - SEK	08/01/24	443,267
SEK	114,521,129	USD	(10,937,349)	R - SEK	03/01/24	426,298
EUR	6,981,058	USD	(7,612,689)	M - EUR	08/01/24	100,413
EUR	3,349,297	USD	(3,617,028)	M - EUR	03/01/24	82,774
USD	11,431,987	SEK	(114,521,129)	R - SEK	03/01/24	68,340
EUR	1,957,022	USD	(2,134,781)	R - EUR	08/01/24	27,457
EUR	969,196	USD	(1,046,664)	R - EUR	03/01/24	23,958
EUR	1,361,155	USD	(1,484,774)	C - EUR	08/01/24	19,113
EUR	673,340	USD	(727,160)	C - EUR	03/01/24	16,645
EUR	485,458	USD	(529,554)	B - EUR	08/01/24	6,811
EUR	240,428	USD	(259,646)	B - EUR	03/01/24	5,943
GBP	203,154	USD	(257,059)	S - GBP (AIDiv)	08/01/24	1,929
CHF	61,183	USD	(70,891)	R - CHF	08/01/24	1,842
GBP	101,061	USD	(127,239)	S - GBP (AIDiv)	03/01/24	1,593
EUR	110,218	USD	(120,230)	Q - EUR	08/01/24	1,545
EUR	54,588	USD	(58,951)	Q - EUR	03/01/24	1,349
CHF	30,434	USD	(34,910)	R - CHF	03/01/24	1,251
EUR	52,981	USD	(57,793)	R - EUR (AIDiv)	08/01/24	743
GBP	77,390	USD	(97,925)	D - GBP (QIDiv)	08/01/24	735
GBP	73,071	USD	(92,459)	DR - GBP (QIDiv)	08/01/24	694
EUR	26,238	USD	(28,335)	R - EUR (AIDiv)	03/01/24	649
GBP	38,498	USD	(48,470)	D - GBP (QIDiv)	03/01/24	607
GBP	36,348	USD	(45,763)	DR - GBP (QIDiv)	03/01/24	573
GBP	19,021	USD	(24,068)	C - GBP (AIDiv)	08/01/24	180

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
GBP	9,462	USD	(11,913)	C - GBP (AIDiv)	03/01/24	149
CHF	1,630	USD	(1,889)	Q - CHF	08/01/24	49
USD	2,717	SEK	(27,025)	R - SEK	08/01/24	35
CHF	811	USD	(930)	Q - CHF	03/01/24	33
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						1,234,975
USD	11,375,065	SEK	(119,079,795)	R - SEK	08/01/24	(443,265)
USD	3,921,902	EUR	(3,631,761)	M - EUR	08/01/24	(90,690)
SEK	115,720,147	USD	(11,552,466)	R - SEK	08/01/24	(67,571)
USD	1,066,767	EUR	(987,826)	R - EUR	08/01/24	(24,644)
USD	742,782	EUR	(687,815)	C - EUR	08/01/24	(17,158)
USD	3,690,787	EUR	(3,349,297)	M - EUR	03/01/24	(9,015)
USD	264,612	EUR	(245,030)	B - EUR	08/01/24	(6,112)
USD	1,068,014	EUR	(969,196)	R - EUR	03/01/24	(2,609)
USD	741,993	EUR	(673,340)	C - EUR	03/01/24	(1,812)
USD	128,535	GBP	(102,093)	S - GBP (AIDiv)	08/01/24	(1,617)
USD	60,077	EUR	(55,631)	Q - EUR	08/01/24	(1,388)
USD	35,269	CHF	(30,749)	R - CHF	08/01/24	(1,284)
USD	28,879	EUR	(26,742)	R - EUR (AIDiv)	08/01/24	(668)
USD	264,942	EUR	(240,428)	B - EUR	03/01/24	(647)
USD	48,965	GBP	(38,892)	D - GBP (QIDiv)	08/01/24	(616)
USD	46,235	GBP	(36,723)	DR - GBP (QIDiv)	08/01/24	(582)
USD	35,622	CHF	(30,434)	R - CHF	03/01/24	(538)
USD	128,524	GBP	(101,061)	S - GBP (AIDiv)	03/01/24	(309)
EUR	35,583	USD	(39,531)	M - EUR	08/01/24	(217)
USD	12,034	GBP	(9,559)	C - GBP (AIDiv)	08/01/24	(152)
USD	60,153	EUR	(54,588)	Q - EUR	03/01/24	(147)
USD	48,959	GBP	(38,498)	D - GBP (QIDiv)	03/01/24	(118)
USD	46,225	GBP	(36,348)	DR - GBP (QIDiv)	03/01/24	(111)
USD	28,913	EUR	(26,238)	R - EUR (AIDiv)	03/01/24	(71)
EUR	10,170	USD	(11,299)	R - EUR	08/01/24	(62)
EUR	7,168	USD	(7,964)	C - EUR	08/01/24	(44)
USD	940	CHF	(819)	Q - CHF	08/01/24	(34)
USD	12,033	GBP	(9,462)	C - GBP (AIDiv)	03/01/24	(29)
EUR	2,554	USD	(2,838)	B - EUR	08/01/24	(16)
USD	949	CHF	(811)	Q - CHF	03/01/24	(14)
EUR	582	USD	(647)	Q - EUR	08/01/24	(4)
GBP	1,084	USD	(1,385)	S - GBP (AIDiv)	08/01/24	(3)
CHF	315	USD	(377)	R - CHF	08/01/24	(2)
EUR	275	USD	(306)	R - EUR (AIDiv)	08/01/24	(2)
GBP	383	USD	(490)	DR - GBP (QIDiv)	08/01/24	(1)
GBP	411	USD	(525)	D - GBP (QIDiv)	08/01/24	(1)
CHF	8	USD	(10)	Q - CHF	08/01/24	0
GBP	101	USD	(129)	C - GBP (AIDiv)	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(671,553)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Select Bond Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
COP	22,736,850,821	USD	(5,209,748)	18/01/24	640,468
THB	181,057,674	USD	(4,955,245)	18/01/24	356,582
GBP	6,510,987	USD	(7,980,000)	18/01/24	320,933
MXN	69,189,696	USD	(3,801,961)	18/01/24	273,143
NOK	68,850,820	EUR	(5,931,405)	18/01/24	226,056
PLN	18,971,139	EUR	(4,171,557)	18/01/24	212,517
CZK	115,657,855	USD	(4,963,162)	18/01/24	209,163
CNY	62,333,497	USD	(8,611,019)	18/01/24	194,443
PLN	8,086,256	USD	(1,875,470)	18/01/24	180,497
PEN	24,747,321	USD	(6,511,884)	18/01/24	168,630
EUR	4,143,012	USD	(4,412,400)	18/01/24	167,027
CLP	3,089,659,792	USD	(3,380,742)	18/01/24	154,510
MYR	39,136,694	USD	(8,387,697)	18/01/24	153,792
BRL	21,398,052	USD	(4,244,596)	02/02/24	152,821
KRW	6,877,461,423	USD	(5,166,686)	18/01/24	140,231
ZAR	108,307,742	USD	(5,775,826)	18/01/24	138,779
CAD	4,660,473	USD	(3,400,000)	18/01/24	135,215
JPY	468,057,844	USD	(3,195,196)	18/01/24	132,840
IDR	83,895,738,461	USD	(5,337,692)	18/01/24	104,219
HUF	897,542,300	USD	(2,501,667)	18/01/24	86,567
TWD	89,587,611	USD	(2,858,500)	18/01/24	84,082
RON	12,863,171	USD	(2,793,395)	18/01/24	62,312
MYR	12,487,158	USD	(2,686,058)	18/01/24	39,235
KZT	195,708,966	USD	(399,296)	18/01/24	27,948
CNY	5,462,134	USD	(750,000)	17/01/24	21,587
HUF	237,059,533	EUR	(600,000)	17/01/24	20,537
USD	2,240,000	KRW	(2,890,537,263)	18/01/24	9,549
INR	559,504,605	USD	(6,710,000)	18/01/24	8,764
HUF	830,377,012	EUR	(2,160,000)	18/01/24	7,021
TRY	17,406,575	USD	(580,000)	18/01/24	1,383
EUR	1,360,000	HUF	(521,043,238)	18/01/24	732
USD	1,150,000	HUF	(398,590,617)	18/01/24	588

Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt

4,432,171

USD	12,965,718	COP	(54,761,425,576)	18/01/24	(1,124,456)
USD	7,985,805	GBP	(6,523,471)	18/01/24	(331,047)
USD	7,706,206	EUR	(7,252,058)	18/01/24	(309,767)
USD	2,811,029	MXN	(51,022,822)	18/01/24	(194,089)
EUR	5,120,408	HUF	(2,023,595,727)	18/01/24	(175,645)
USD	4,200,000	CLP	(3,822,976,896)	18/01/24	(174,327)
USD	5,981,870	ZAR	(112,488,618)	18/01/24	(161,050)
EUR	4,750,000	NOK	(54,866,428)	18/01/24	(154,352)
USD	5,414,176	CNY	(39,335,916)	18/01/24	(142,563)
USD	3,400,000	CAD	(4,664,594)	18/01/24	(138,340)
USD	2,350,382	THB	(84,559,465)	18/01/24	(130,402)
USD	5,340,011	PEN	(20,226,732)	18/01/24	(120,176)
EUR	4,160,000	PLN	(18,466,634)	18/01/24	(97,021)
USD	1,910,000	CZK	(44,560,579)	18/01/24	(82,790)
USD	6,244,790	IDR	(97,386,975,596)	18/01/24	(72,231)
USD	2,703,540	RON	(12,419,018)	18/01/24	(53,561)
USD	700,000	JPY	(104,650,210)	18/01/24	(44,096)
USD	1,994,733	HUF	(704,961,802)	18/01/24	(38,158)
USD	720,000	CZK	(16,878,895)	17/01/24	(34,868)
USD	2,020,000	MYR	(9,406,142)	18/01/24	(32,868)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Select Bond Fund (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
USD	1,280,000	KRW	(1,700,946,400)	18/01/24	(32,516)
USD	7,430,000	INR	(621,389,419)	18/01/24	(31,903)
USD	1,670,000	MYR	(7,794,955)	18/01/24	(31,230)
USD	1,210,000	TWD	(37,644,072)	18/01/24	(26,451)
USD	754,033	CRC	(401,598,000)	18/01/24	(16,422)
EGP	9,891,000	USD	(210,000)	10/12/24	(15,433)
USD	190,000	KZT	(93,575,000)	18/01/24	(14,280)
KRW	1,530,902,226	USD	(1,190,000)	18/01/24	(8,696)
USD	298,835	TRY	(9,117,937)	18/01/24	(5,706)
USD	88,794	PLN	(369,000)	18/01/24	(5,026)
EUR	180,000	NOK	(2,060,023)	17/01/24	(3,968)
NOK	8,519,629	EUR	(760,000)	18/01/24	(817)
MYR	773,024	USD	(169,226)	18/01/24	(515)
INR	61,587,240	USD	(740,000)	18/01/24	(435)
CZK	5,666,479	USD	(253,839)	18/01/24	(429)
EUR	90,792	RON	(453,682)	18/01/24	(364)
CZK	2,238,840	EUR	(90,715)	18/01/24	(148)
CNY	1,358,681	USD	(191,961)	18/01/24	(29)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(3,806,175)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
EUR	59,241,511	USD	(63,981,808)	I - EUR	08/01/24	1,471,844
EUR	14,278,852	USD	(15,486,520)	M - EUR	08/01/24	289,631
EUR	1,246,133	USD	(1,345,844)	B - EUR	08/01/24	30,960
EUR	1,055,395	USD	(1,139,838)	R - EUR	08/01/24	26,227
NOK	2,685,888	USD	(245,986)	R - NOK	08/01/24	18,519
SEK	1,991,361	USD	(190,269)	R - SEK	08/01/24	7,368
EUR	78,588	USD	(84,897)	C - EUR	08/01/24	1,932
USD	847	SEK	(8,394)	R - SEK	08/01/24	13
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						1,846,494
USD	420,093	EUR	(389,192)	M - EUR	08/01/24	(9,910)
USD	408,622	EUR	(378,611)	I - EUR	08/01/24	(9,690)
USD	38,044	EUR	(34,824)	R - EUR	08/01/24	(431)
USD	8,602	EUR	(7,971)	B - EUR	08/01/24	(204)
USD	1,603	NOK	(17,589)	R - NOK	08/01/24	(130)
USD	1,349	SEK	(14,091)	R - SEK	08/01/24	(50)
USD	2,158	EUR	(1,972)	C - EUR	08/01/24	(20)
EUR	1,022	USD	(1,136)	C - EUR	08/01/24	(6)
SEK	1,687	USD	(170)	R - SEK	08/01/24	(2)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(20,443)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
EUR	1,350,000	USD	(1,481,223)	18/01/24	10,983
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					10,983
USD	1,109,480	COP	(4,823,318,393)	18/01/24	(131,566)
USD	3,221,572	EUR	(2,995,000)	18/01/24	(88,913)
GBP	7,878	USD	(10,045)	08/01/24	(2)
SGD	1,249	USD	(947)	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(220,481)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
EUR	62,998,861	USD	(68,021,117)	I - EUR (Perf)	08/01/24	1,583,886
EUR	9,335,798	USD	(10,079,958)	R - EUR	08/01/24	234,804
EUR	2,085,116	USD	(2,251,324)	R - EUR (AIDiv)	08/01/24	52,440
EUR	1,446,725	USD	(1,562,061)	S - EUR	08/01/24	36,368
EUR	498,982	USD	(538,760)	B - EUR	08/01/24	12,546
CHF	282,651	USD	(324,170)	B - CHF	08/01/24	11,835
EUR	407,431	USD	(439,911)	I - EUR	08/01/24	10,244
GBP	524,110	USD	(659,760)	DR - GBP (QIDiv)	08/01/24	8,394
CHF	190,799	USD	(218,826)	R - CHF	08/01/24	7,989
CHF	101,464	USD	(116,368)	S - CHF	08/01/24	4,248
NOK	582,111	USD	(53,269)	S - NOK	08/01/24	4,057
EUR	145,718	USD	(157,335)	S - EUR (AIDiv)	08/01/24	3,663
GBP	225,174	USD	(283,454)	X - GBP	08/01/24	3,606
EUR	132,407	USD	(142,963)	C - EUR (AIDiv)	08/01/24	3,330
SGD	258,547	USD	(193,091)	R - SGD (MIDiv)	08/01/24	2,957
NOK	315,973	USD	(28,914)	R - NOK	08/01/24	2,203
GBP	83,170	USD	(104,697)	C - GBP (AIDiv)	08/01/24	1,332
EUR	42,320	USD	(45,694)	C - EUR	08/01/24	1,063
EUR	23,550	USD	(25,428)	M - EUR	08/01/24	593
GBP	31,347	USD	(39,461)	S - GBP (AIDiv)	08/01/24	502
EUR	7,513	USD	(8,112)	Q - EUR (AIDiv)	08/01/24	188
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					1,986,248	
USD	236,918	EUR	(219,174)	R - EUR	08/01/24	(5,240)
USD	46,785	EUR	(43,343)	R - EUR (AIDiv)	08/01/24	(1,102)
USD	16,527	EUR	(15,127)	I - EUR (Perf)	08/01/24	(185)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(6,527)	

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Global Convertible Bond Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
JPY	30,682,830	USD	(209,865)	18/01/24	8,300
EUR	111,000	USD	(117,708)	18/01/24	4,985
AUD	46,058	USD	(29,335)	18/01/24	2,109
SGD	71,080	USD	(52,134)	18/01/24	1,791
HKD	1,196,916	USD	(153,125)	18/01/24	210
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					17,395
USD	225,419	GBP	(185,000)	18/01/24	(10,440)
USD	173,650	EUR	(163,000)	18/01/24	(6,520)
USD	39,350	JPY	(5,800,000)	18/01/24	(1,890)
GBP	1,622	USD	(2,068)	08/01/24	(1)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(18,851)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
CHF	559,156	USD	(641,172)	S - CHF (BHedged)	08/01/24	23,531
EUR	401,577	USD	(433,692)	R - EUR	08/01/24	9,994
CHF	190,751	USD	(218,795)	R - CHF	08/01/24	7,963
GBP	272,744	USD	(343,367)	X - GBP	08/01/24	4,336
CHF	182,155	EUR	(193,466)	S - CHF (BHedged)	08/01/24	2,786
GBP	153,818	USD	(193,647)	B - GBP	08/01/24	2,444
EUR	95,271	USD	(102,891)	X - EUR	08/01/24	2,370
EUR	90,952	USD	(98,225)	R - EUR (AIDiv)	08/01/24	2,264
GBP	58,625	USD	(73,806)	DR - GBP (QIDiv)	08/01/24	931
GBP	36,447	USD	(45,885)	D - GBP (QIDiv)	08/01/24	579
EUR	21,535	USD	(23,257)	B - EUR	08/01/24	537
CHF	10,843	HKD	(97,120)	S - CHF (BHedged)	08/01/24	452
CHF	4,503	GBP	(4,100)	S - CHF (BHedged)	08/01/24	125
CHF	4,265	SGD	(6,551)	S - CHF (BHedged)	08/01/24	104
CHF	1,229	CAD	(1,911)	S - CHF (BHedged)	08/01/24	12
CHF	4,247	AUD	(7,396)	S - CHF (BHedged)	08/01/24	1
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					58,429	
USD	292,566	EUR	(271,030)	B - USD (Perf)- (BHedged)	08/01/24	(6,885)
USD	86,785	JPY	(12,723,204)	B - USD (Perf)- (BHedged)	09/01/24	(3,549)
USD	6,962	AUD	(10,575)	B - USD (Perf)- (BHedged)	08/01/24	(255)
CHF	54,037	JPY	(9,078,788)	S - CHF (BHedged)	09/01/24	(214)
USD	6,853	SGD	(9,178)	B - USD (Perf)- (BHedged)	08/01/24	(106)
USD	7,230	GBP	(5,744)	B - USD (Perf)- (BHedged)	08/01/24	(93)
USD	1,975	CAD	(2,677)	B - USD (Perf)- (BHedged)	08/01/24	(55)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Global Convertible Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
EUR	4,643	USD	(5,158)	R - EUR	08/01/24	(28)
CHF	2,175	USD	(2,602)	R - CHF	08/01/24	(17)
GBP	4,983	USD	(6,363)	X - GBP	08/01/24	(11)
EUR	1,133	USD	(1,259)	X - EUR	08/01/24	(7)
GBP	2,764	USD	(3,530)	B - GBP	08/01/24	(6)
EUR	1,052	USD	(1,168)	R - EUR (AIDiv)	08/01/24	(6)
				B - USD (Perf)- (BHedged)	08/01/24	(3)
USD	17,425	HKD	(136,074)			
GBP	1,037	USD	(1,324)	DR - GBP (QIDiv)	08/01/24	(3)
EUR	252	USD	(280)	B - EUR	08/01/24	(2)
GBP	655	USD	(836)	D - GBP (QIDiv)	08/01/24	(1)
CHF	87	AUD	(152)	S - CHF (BHedged)	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(11,241)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
PLN	163,614,105	EUR	(35,885,601)	18/01/24	1,933,911
MXN	446,186,399	USD	(24,437,821)	18/01/24	1,841,459
JPY	4,956,213,337	USD	(33,791,628)	18/01/24	1,448,593
CLP	25,920,028,816	USD	(28,599,820)	18/01/24	1,058,402
PEN	151,718,284	USD	(39,939,478)	18/01/24	1,016,714
BRL	141,997,372	USD	(28,300,615)	02/02/24	880,625
IDR	552,585,465,846	USD	(35,085,727)	18/01/24	757,813
COP	28,510,546,596	USD	(6,609,372)	18/01/24	726,423
ZAR	711,670,996	USD	(38,176,578)	18/01/24	687,239
TWD	418,522,656	USD	(13,275,491)	18/01/24	471,245
CNY	110,339,626	USD	(15,184,878)	18/01/24	402,112
KZT	2,253,350,000	USD	(4,601,021)	18/01/24	318,175
KRW	17,828,133,223	USD	(13,665,491)	18/01/24	91,389
EUR	1,970,000	USD	(2,086,897)	18/01/24	90,618
MYR	46,864,760	USD	(10,137,743)	18/01/24	90,378
RON	5,031,687	USD	(1,065,908)	18/01/24	51,159
HUF	1,330,228,000	USD	(3,796,214)	18/01/24	39,752
MYR	13,093,523	USD	(2,832,257)	18/01/24	25,373
EUR	841,659	IDR	(14,022,880,000)	18/01/24	20,721
TRY	101,393,240	USD	(3,380,000)	18/01/24	6,553
INR	1,142,174,126	USD	(13,709,452)	18/01/24	6,253
CAD	20,429	USD	(15,438)	08/01/24	57
EUR	3,444	USD	(3,804)	08/01/24	1
USD	85	GBP	(67)	08/01/24	0
USD	15,494	CAD	(20,429)	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					11,964,965
USD	42,723,232	COP	(185,733,699,067)	18/01/24	(5,066,253)
USD	31,905,566	JPY	(4,724,047,991)	18/01/24	(1,683,886)
USD	25,792,837	ZAR	(497,241,102)	18/01/24	(1,361,125)
USD	45,640,050	PEN	(173,459,790)	18/01/24	(1,185,241)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
EUR	34,302,602	PLN	(152,908,297)	18/01/24	(961,659)
USD	12,043,450	CLP	(11,303,439,767)	18/01/24	(890,174)
USD	18,383,743	EUR	(17,220,421)	18/01/24	(650,635)
USD	5,441,326	PLN	(23,726,049)	18/01/24	(591,127)
USD	12,821,365	MXN	(227,112,438)	18/01/24	(554,998)
USD	34,378,472	IDR	(537,877,854,107)	18/01/24	(511,059)
USD	15,224,384	CNY	(110,457,321)	18/01/24	(379,231)
USD	3,483,347	HUF	(1,287,047,852)	18/01/24	(228,101)
USD	8,890,000	BRL	(43,976,163)	02/02/24	(147,343)
USD	13,640,000	INR	(1,142,353,288)	18/01/24	(77,857)
USD	4,389,108	TRY	(133,647,895)	18/01/24	(74,757)
USD	10,749,129	RON	(48,680,848)	18/01/24	(58,330)
USD	428,391	KZT	(210,982,568)	18/01/24	(32,196)
USD	324,409	THB	(11,928,503)	18/01/24	(25,547)
USD	558,354	KRW	(750,685,325)	18/01/24	(20,903)
EUR	460,940	HUF	(182,271,154)	18/01/24	(16,119)
CZK	3,244,845	EUR	(131,478)	18/01/24	(215)
GBP	92,180	USD	(117,543)	08/01/24	(29)

Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt

(14,516,785)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
EUR	165,982,025	USD	(179,221,064)	G - EUR (Perf)	08/01/24	4,166,048
EUR	162,969,062	USD	(175,968,439)	G - EUR (Perf)	04/01/24	4,062,318
EUR	92,641,600	USD	(100,030,970)	I - EUR	08/01/24	2,325,146
EUR	90,909,069	USD	(98,159,893)	I - EUR	04/01/24	2,266,705
EUR	44,589,342	USD	(48,146,208)	M - EUR	08/01/24	1,118,830
EUR	42,701,413	USD	(46,101,065)	M - EUR	04/01/24	1,070,880
USD	181,060,795	EUR	(162,969,062)	G - EUR (Perf)	04/01/24	1,030,038
EUR	24,914,469	USD	(26,920,458)	S - EUR	08/01/24	606,574
EUR	24,477,547	USD	(26,448,787)	S - EUR	04/01/24	591,385
USD	101,001,185	EUR	(90,909,069)	I - EUR	04/01/24	574,587
EUR	20,553,625	USD	(22,191,866)	K - EUR	08/01/24	517,039
GBP	32,988,045	USD	(41,575,351)	S - GBP	08/01/24	478,920
GBP	32,501,190	USD	(40,959,450)	S - GBP	04/01/24	473,266
EUR	16,478,936	USD	(17,788,861)	K - EUR	04/01/24	415,302
USD	47,441,838	EUR	(42,701,413)	M - EUR	04/01/24	269,892
EUR	7,098,676	USD	(7,664,873)	Q - EUR	08/01/24	178,178
EUR	6,832,054	USD	(7,375,897)	Q - EUR	04/01/24	171,423
USD	27,194,881	EUR	(24,477,547)	S - EUR	04/01/24	154,709
USD	41,564,598	GBP	(32,501,190)	S - GBP	04/01/24	131,883
USD	18,308,317	EUR	(16,478,936)	K - EUR	04/01/24	104,154
GBP	4,724,399	USD	(5,947,281)	C - GBP	08/01/24	75,543
GBP	4,632,071	USD	(5,830,275)	C - GBP	04/01/24	74,718
GBP	3,452,623	USD	(4,355,221)	S - GBP (QIDiv)	08/01/24	46,299
GBP	3,419,094	USD	(4,313,099)	S - GBP (QIDiv)	04/01/24	45,582
USD	7,590,502	EUR	(6,832,054)	Q - EUR	04/01/24	43,182
SEK	8,716,602	USD	(833,372)	ER - SEK	08/01/24	31,727
SEK	7,368,169	USD	(703,714)	ER - SEK	04/01/24	27,440
USD	5,923,788	GBP	(4,632,071)	C - GBP	04/01/24	18,796

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
CAD	1,520,404	USD	(1,136,802)	S - CAD (QIDiv)	08/01/24	16,333
GBP	1,009,972	USD	(1,271,400)	X - GBP	08/01/24	16,146
GBP	1,002,158	USD	(1,261,571)	X - GBP	04/01/24	15,986
CAD	757,529	USD	(559,026)	S - CAD (QIDiv)	04/01/24	15,479
USD	4,372,556	GBP	(3,419,094)	S - GBP (QIDiv)	04/01/24	13,874
USD	743,138	SEK	(7,368,169)	ER - SEK	04/01/24	11,984
EUR	208,438	USD	(225,065)	X - EUR	08/01/24	5,230
EUR	204,656	USD	(220,982)	X - EUR	04/01/24	5,101
USD	1,281,623	GBP	(1,002,158)	X - GBP	04/01/24	4,067
EUR	130,397	USD	(140,798)	C - EUR (QIDiv)	08/01/24	3,272
EUR	128,030	USD	(138,243)	C - EUR (QIDiv)	04/01/24	3,191
USD	227,376	EUR	(204,656)	X - EUR	04/01/24	1,293
USD	142,243	EUR	(128,030)	C - EUR (QIDiv)	04/01/24	809
CHF	23,907	USD	(27,858)	R - CHF	08/01/24	563
CHF	11,954	USD	(13,710)	R - CHF	04/01/24	495
USD	79,480	EUR	(71,539)	M - EUR	08/01/24	440
EUR	12,712	USD	(13,726)	R - EUR	08/01/24	319
EUR	12,481	USD	(13,477)	R - EUR	04/01/24	311
GBP	10,363	USD	(13,045)	Q - GBP	08/01/24	167
GBP	10,283	USD	(12,944)	Q - GBP	04/01/24	164
GBP	9,694	USD	(12,204)	Q - GBP (QIDiv)	08/01/24	156
GBP	9,673	USD	(12,177)	Q - GBP (QIDiv)	04/01/24	154
USD	128,700	GBP	(100,836)	S - GBP	08/01/24	151
USD	13,867	EUR	(12,481)	R - EUR	04/01/24	79
USD	8,588	SEK	(85,874)	ER - SEK	08/01/24	66
USD	10,617	EUR	(9,556)	I - EUR	08/01/24	58
USD	13,150	GBP	(10,283)	Q - GBP	04/01/24	42
USD	12,370	GBP	(9,673)	Q - GBP (QIDiv)	04/01/24	39
USD	238	EUR	(214)	Q - EUR	08/01/24	1
USD	1	GBP	(1)	C - GBP	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						21,186,534
USD	179,221,064	EUR	(165,982,025)	G - EUR (Perf)	08/01/24	(4,166,048)
USD	100,020,656	EUR	(92,632,316)	I - EUR	08/01/24	(2,325,203)
USD	48,067,106	EUR	(44,518,144)	M - EUR	08/01/24	(1,119,268)
EUR	164,111,431	USD	(182,329,926)	G - EUR (Perf)	08/01/24	(1,009,561)
USD	26,920,458	EUR	(24,914,469)	S - EUR	08/01/24	(606,575)
EUR	91,542,243	USD	(101,704,618)	I - EUR	08/01/24	(563,139)
USD	22,191,865	EUR	(20,553,625)	K - EUR	08/01/24	(517,039)
USD	41,448,692	GBP	(32,888,805)	S - GBP	08/01/24	(479,067)
EUR	42,999,678	USD	(47,773,199)	M - EUR	08/01/24	(264,520)
USD	7,666,842	EUR	(7,100,448)	Q - EUR	08/01/24	(178,166)
EUR	24,646,958	USD	(27,383,090)	S - EUR	08/01/24	(151,620)
GBP	32,738,961	USD	(41,868,291)	S - GBP	08/01/24	(131,558)
EUR	16,595,483	USD	(18,437,796)	K - EUR	08/01/24	(102,090)
USD	5,948,821	GBP	(4,725,603)	C - GBP	08/01/24	(75,537)
USD	4,355,221	GBP	(3,452,623)	S - GBP (QIDiv)	08/01/24	(46,299)
EUR	6,881,837	USD	(7,645,810)	Q - EUR	08/01/24	(42,335)
USD	827,119	SEK	(8,653,961)	ER - SEK	08/01/24	(31,761)
GBP	4,665,933	USD	(5,967,041)	C - GBP	08/01/24	(18,752)
USD	1,271,400	GBP	(1,009,972)	X - GBP	08/01/24	(16,147)
USD	559,017	CAD	(757,529)	S - CAD (QIDiv)	08/01/24	(15,524)
GBP	3,439,757	USD	(4,398,947)	S - GBP (QIDiv)	08/01/24	(13,829)
SEK	7,418,812	USD	(748,227)	ER - SEK	08/01/24	(11,930)
USD	225,065	EUR	(208,438)	X - EUR	08/01/24	(5,231)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
GBP	1,009,387	USD	(1,290,856)	X - GBP	08/01/24	(4,057)
USD	140,798	EUR	(130,397)	C - EUR (QIDiv)	08/01/24	(3,273)
EUR	206,124	USD	(229,006)	X - EUR	08/01/24	(1,268)
EUR	128,928	USD	(143,240)	C - EUR (QIDiv)	08/01/24	(794)
USD	573,731	CAD	(757,529)	S - CAD (QIDiv)	04/01/24	(773)
USD	13,709	CHF	(11,954)	R - CHF	08/01/24	(501)
USD	13,726	EUR	(12,712)	R - EUR	08/01/24	(320)
USD	13,045	GBP	(10,363)	Q - GBP	08/01/24	(165)
USD	12,204	GBP	(9,694)	Q - GBP (QIDiv)	08/01/24	(155)
EUR	12,567	USD	(13,962)	R - EUR	08/01/24	(78)
USD	14,148	CHF	(11,954)	R - CHF	04/01/24	(56)
GBP	10,355	USD	(13,243)	Q - GBP	08/01/24	(41)
GBP	9,741	USD	(12,457)	Q - GBP (QIDiv)	08/01/24	(39)
CHF	81	USD	(96)	R - CHF	08/01/24	(1)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(11,902,720)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) EUR
EUR	164,042,061	USD	(175,526,389)	18/01/24	5,243,224
JPY	16,081,011,565	USD	(109,753,789)	18/01/24	4,150,110
SEK	594,795,872	EUR	(50,500,000)	18/01/24	2,929,579
PLN	150,985,462	EUR	(33,490,000)	18/01/24	1,240,284
CHF	17,035,709	EUR	(18,070,000)	18/01/24	271,792
GBP	30,246,609	EUR	(34,650,000)	18/01/24	236,837
JPY	558,937,398	EUR	(3,470,000)	18/01/24	125,480
HUF	5,927,086,990	EUR	(15,370,000)	18/01/24	93,020
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					14,290,326
USD	83,050,000	JPY	(12,181,352,670)	18/01/24	(3,223,683)
USD	75,368,484	EUR	(71,369,583)	18/01/24	(3,183,667)
USD	46,167,911	GBP	(38,045,062)	18/01/24	(2,113,537)
EUR	53,640,000	CHF	(51,016,843)	18/01/24	(1,288,168)
EUR	52,520,000	SEK	(597,181,740)	18/01/24	(1,123,898)
EUR	33,240,000	HUF	(13,023,882,866)	18/01/24	(737,661)
GBP	65,216,697	EUR	(75,794,788)	18/01/24	(572,990)
EUR	35,080,000	PLN	(153,924,297)	18/01/24	(326,287)
EUR	99,956,778	GBP	(86,926,572)	18/01/24	(305,477)
EUR	4,786,099	JPY	(744,520,723)	18/01/24	(3,185)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(12,878,553)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) EUR
CHF	66,005,954	EUR	(70,094,182)	Q - CHF	08/01/24	924,099
EUR	147,256	USD	(159,113)	B - USD	08/01/24	3,244
EUR	167,224	USD	(182,529)	Q - USD	08/01/24	2,020
USD	182,108	EUR	(163,919)	B - USD	08/01/24	905
CHF	24,530	EUR	(26,052)	R - CHF	08/01/24	341
EUR	10,316	USD	(11,147)	R - USD	08/01/24	227
USD	12,572	EUR	(11,316)	R - USD	08/01/24	62
USD	7,875	EUR	(7,088)	Q - USD	08/01/24	39
EUR	656	USD	(708)	I - USD	08/01/24	14
EUR	10,927	CHF	(10,146)	Q - CHF	08/01/24	11
GBP	1,968	EUR	(2,262)	R - GBP	08/01/24	9
EUR	323	USD	(349)	M - USD	08/01/24	7
USD	504	EUR	(454)	I - USD	08/01/24	3
USD	399	EUR	(359)	M - USD	08/01/24	2
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						930,983
USD	22,134,938	EUR	(20,502,625)	B - USD	08/01/24	(468,488)
USD	1,543,680	EUR	(1,429,844)	R - USD	08/01/24	(32,672)
USD	1,195,247	EUR	(1,107,099)	Q - USD	08/01/24	(25,290)
EUR	646,000	CHF	(608,970)	Q - CHF	08/01/24	(9,213)
GBP	241,674	EUR	(281,953)	R - GBP	08/01/24	(3,101)
USD	98,176	EUR	(90,936)	I - USD	08/01/24	(2,078)
USD	48,333	EUR	(44,769)	M - USD	08/01/24	(1,023)
CHF	33	EUR	(36)	Q - CHF	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(541,865)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) EUR
EUR	154,544,597	USD	(164,807,177)	18/01/24	5,443,437
JPY	10,395,728,009	USD	(70,945,705)	18/01/24	2,688,047
SEK	388,692,875	EUR	(33,000,000)	18/01/24	1,915,671
PLN	99,589,993	EUR	(22,090,000)	18/01/24	818,090
CHF	10,879,473	EUR	(11,540,000)	18/01/24	173,574
GBP	19,134,363	EUR	(21,920,000)	18/01/24	149,826
JPY	322,154,120	EUR	(2,000,000)	18/01/24	72,323
HUF	4,052,939,770	EUR	(10,510,000)	18/01/24	63,607
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					11,324,575
USD	50,083,022	EUR	(47,454,920)	18/01/24	(2,144,778)
USD	54,265,000	JPY	(7,960,883,037)	18/01/24	(2,116,447)
USD	36,290,797	GBP	(29,907,247)	18/01/24	(1,663,106)
EUR	34,000,000	CHF	(32,337,298)	18/01/24	(816,512)
EUR	34,330,000	SEK	(390,303,676)	18/01/24	(730,367)
EUR	21,940,000	HUF	(8,596,389,593)	18/01/24	(486,892)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) EUR
GBP	38,221,899	EUR	(44,432,635)	18/01/24	(346,993)
EUR	94,373,127	GBP	(82,041,250)	18/01/24	(254,333)
EUR	23,190,000	PLN	(101,753,262)	18/01/24	(215,694)
EUR	3,968,311	JPY	(617,317,625)	18/01/24	(2,712)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(8,777,834)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) EUR
JPY	30,099,286,413	EUR	(189,963,686)	S - JPY	09/01/24	3,449,043
NOK	12,920,452	EUR	(1,095,762)	R - NOK	08/01/24	55,876
CHF	3,003,095	EUR	(3,189,356)	Q - CHF	08/01/24	41,786
EUR	267,906	USD	(289,478)	I - USD	08/01/24	5,902
CHF	405,924	EUR	(431,101)	B - CHF	08/01/24	5,648
USD	233,854	EUR	(210,497)	I - USD	08/01/24	1,163
EUR	3,179	USD	(3,435)	B - USD	08/01/24	70
EUR	1,145	USD	(1,237)	R - USD	08/01/24	25
USD	2,712	EUR	(2,441)	B - USD	08/01/24	13
EUR	496	USD	(536)	M - USD	08/01/24	11
USD	1,753	EUR	(1,578)	R - USD	08/01/24	9
USD	426	EUR	(383)	M - USD	08/01/24	2
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					3,559,548	

USD	40,238,842	EUR	(37,271,639)	I - USD	08/01/24	(851,817)
JPY	345,923,554	EUR	(2,237,313)	S - JPY	09/01/24	(14,469)
USD	470,076	EUR	(435,413)	B - USD	08/01/24	(9,951)
USD	307,327	EUR	(284,612)	R - USD	08/01/24	(6,454)
USD	73,428	EUR	(68,014)	M - USD	08/01/24	(1,555)
EUR	106,886	CHF	(100,340)	Q - CHF	08/01/24	(1,073)
CHF	17,329	EUR	(18,655)	Q - CHF	08/01/24	(10)
CHF	2,302	EUR	(2,478)	B - CHF	08/01/24	(1)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(885,330)	

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
EUR	3,000,000	USD	(3,269,156)	18/01/24	46,857
USD	4,221,390	GBP	(3,311,052)	18/01/24	91
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					46,948

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
USD	354,800,920	EUR	(334,113,168)	18/01/24	(14,506,916)
USD	44,705,793	GBP	(36,610,813)	18/01/24	(1,969,763)
GBP	81,490	USD	(103,911)	08/01/24	(26)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(16,476,705)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
EUR	198,872,956	USD	(214,750,228)	I - EUR	08/01/24	4,976,801
EUR	194,784,346	USD	(210,312,883)	I - EUR	04/01/24	4,863,990
EUR	190,134,464	USD	(205,314,418)	I - EUR (Perf)	08/01/24	4,757,788
EUR	187,326,309	USD	(202,283,526)	I - EUR (Perf)	04/01/24	4,654,507
EUR	160,000,908	USD	(172,785,496)	S - EUR	08/01/24	3,993,309
EUR	156,466,299	USD	(168,961,231)	S - EUR	04/01/24	3,885,970
NOK	253,845,676	USD	(23,234,448)	I - NOK	08/01/24	1,764,164
NOK	247,470,189	USD	(22,651,766)	I - NOK	04/01/24	1,716,478
GBP	95,181,124	USD	(119,826,851)	S - GBP (AIDiv)	08/01/24	1,513,259
GBP	95,179,007	USD	(119,826,523)	S - GBP (AIDiv)	04/01/24	1,508,258
CHF	58,598,373	USD	(68,285,743)	R - CHF	08/01/24	1,373,800
USD	216,407,999	EUR	(194,784,346)	I - EUR	04/01/24	1,231,126
CHF	29,288,116	USD	(33,594,734)	R - CHF	04/01/24	1,207,355
USD	208,122,021	EUR	(187,326,309)	I - EUR (Perf)	04/01/24	1,183,987
USD	173,836,139	EUR	(156,466,299)	S - EUR	04/01/24	988,938
GBP	54,379,422	USD	(68,458,831)	I - GBP	08/01/24	865,892
GBP	54,379,422	USD	(68,459,459)	I - GBP	04/01/24	863,761
EUR	32,343,641	USD	(34,965,486)	I - EUR (AIDiv)	08/01/24	769,751
CHF	32,629,042	USD	(38,021,663)	Q - CHF	08/01/24	766,515
EUR	31,901,779	USD	(34,488,598)	I - EUR (AIDiv)	04/01/24	753,069
CHF	16,291,954	USD	(18,685,935)	Q - CHF	04/01/24	673,250
EUR	18,556,794	USD	(20,038,323)	Q - EUR (AIDiv)	08/01/24	464,361
EUR	18,282,708	USD	(19,742,496)	Q - EUR (AIDiv)	04/01/24	454,280
USD	121,720,997	GBP	(95,179,007)	S - GBP (AIDiv)	04/01/24	386,215
GBP	23,430,667	USD	(29,497,118)	S - GBP	08/01/24	373,086
GBP	23,392,806	USD	(29,449,953)	S - GBP	04/01/24	371,339
EUR	12,829,605	USD	(13,856,278)	C - EUR (AIDiv)	08/01/24	318,657
EUR	12,548,111	USD	(13,550,681)	C - EUR (AIDiv)	04/01/24	311,127
EUR	10,979,795	USD	(11,888,835)	C - EUR	08/01/24	242,315
EUR	10,836,636	USD	(11,734,252)	C - EUR	04/01/24	236,902
USD	69,543,880	GBP	(54,379,422)	I - GBP	04/01/24	220,660
USD	24,576,356	NOK	(247,470,189)	I - NOK	04/01/24	208,112
USD	35,443,301	EUR	(31,901,779)	I - EUR (AIDiv)	04/01/24	201,634
SEK	51,825,534	USD	(4,948,171)	I - SEK	08/01/24	195,366
SEK	51,944,774	USD	(4,960,994)	I - SEK	04/01/24	193,561
EUR	5,661,109	USD	(6,113,073)	B - EUR	08/01/24	141,666
EUR	5,572,784	USD	(6,017,655)	B - EUR	04/01/24	138,559
USD	20,312,331	EUR	(18,282,708)	Q - EUR (AIDiv)	04/01/24	115,555
USD	29,916,215	GBP	(23,392,806)	S - GBP	04/01/24	94,923
USD	5,239,041	SEK	(51,944,774)	I - SEK	04/01/24	84,487
USD	13,941,118	EUR	(12,548,111)	C - EUR (AIDiv)	04/01/24	79,310
GBP	4,587,144	USD	(5,774,795)	Q - GBP (QIDiv)	08/01/24	73,051
GBP	4,519,193	USD	(5,688,758)	Q - GBP (QIDiv)	04/01/24	72,337
USD	12,039,646	EUR	(10,836,636)	C - EUR	04/01/24	68,492
GBP	4,074,799	USD	(5,129,808)	B - GBP	08/01/24	64,884

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
GBP	4,074,799	USD	(5,129,855)	B - GBP	04/01/24	64,724
GBP	3,636,355	USD	(4,577,701)	C - GBP (AIDiv)	08/01/24	58,047
GBP	3,048,317	USD	(3,835,506)	C - GBP (AIDiv)	04/01/24	50,507
NOK	6,650,873	USD	(608,933)	R - NOK	08/01/24	46,043
NOK	6,506,050	USD	(595,716)	R - NOK	04/01/24	44,931
CHF	1,704,781	USD	(1,986,566)	B - CHF	08/01/24	40,014
USD	6,191,437	EUR	(5,572,784)	B - EUR	04/01/24	35,223
CHF	852,391	USD	(977,685)	B - CHF	04/01/24	35,183
EUR	956,722	USD	(1,033,105)	Q - EUR	08/01/24	23,940
EUR	942,591	USD	(1,017,853)	Q - EUR	04/01/24	23,421
USD	5,779,433	GBP	(4,519,193)	Q - GBP (QIDiv)	04/01/24	18,338
EUR	712,647	USD	(769,706)	B - EUR (AIDiv)	08/01/24	17,671
EUR	702,556	USD	(758,815)	B - EUR (AIDiv)	04/01/24	17,293
USD	5,211,114	GBP	(4,074,799)	B - GBP	04/01/24	16,535
EUR	612,026	USD	(660,961)	R - EUR	08/01/24	15,243
CHF	644,743	USD	(751,313)	C - CHF	08/01/24	15,132
EUR	602,982	USD	(651,199)	R - EUR	04/01/24	14,911
CHF	322,371	USD	(369,757)	C - CHF	04/01/24	13,306
USD	3,898,383	GBP	(3,048,317)	C - GBP (AIDiv)	04/01/24	12,369
USD	1,047,231	EUR	(942,591)	Q - EUR	04/01/24	5,958
USD	646,118	NOK	(6,506,050)	R - NOK	04/01/24	5,471
GBP	293,583	USD	(369,596)	X - GBP	08/01/24	4,675
GBP	293,583	USD	(369,599)	X - GBP	04/01/24	4,663
USD	780,549	EUR	(702,556)	B - EUR (AIDiv)	04/01/24	4,440
EUR	175,506	USD	(189,511)	M - EUR	08/01/24	4,399
EUR	162,908	USD	(175,735)	M - EUR	04/01/24	4,229
USD	669,921	EUR	(602,982)	R - EUR	04/01/24	3,811
GBP	82,557	USD	(103,932)	D - GBP (QIDiv)	08/01/24	1,314
GBP	82,557	USD	(103,933)	D - GBP (QIDiv)	04/01/24	1,311
USD	375,453	GBP	(293,583)	X - GBP	04/01/24	1,191
USD	180,993	EUR	(162,908)	M - EUR	04/01/24	1,030
EUR	25,021	USD	(27,017)	X - EUR	08/01/24	627
EUR	24,651	USD	(26,618)	X - EUR	04/01/24	613
USD	105,579	GBP	(82,557)	D - GBP (QIDiv)	04/01/24	335
USD	37,300	EUR	(33,578)	S - EUR	08/01/24	200
USD	27,388	EUR	(24,651)	X - EUR	04/01/24	156
USD	36,902	GBP	(28,912)	Q - GBP (QIDiv)	08/01/24	44
GBP	2,114	USD	(2,661)	C - GBP	04/01/24	34
GBP	2,114	USD	(2,661)	C - GBP	08/01/24	33
USD	2,703	GBP	(2,114)	C - GBP	04/01/24	9
USD	1	EUR	(1)	C - EUR	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						50,030,221

USD	214,750,228	EUR	(198,872,956)	I - EUR	08/01/24	(4,976,801)
USD	205,314,418	EUR	(190,134,464)	I - EUR (Perf)	08/01/24	(4,757,789)
USD	172,780,726	EUR	(159,996,614)	S - EUR	08/01/24	(3,993,338)
USD	23,234,448	NOK	(253,845,676)	I - NOK	08/01/24	(1,764,163)
USD	119,932,261	GBP	(95,263,712)	S - GBP (AIDiv)	08/01/24	(1,513,136)
USD	33,619,989	CHF	(29,310,258)	R - CHF	08/01/24	(1,222,942)
EUR	194,784,346	USD	(216,407,999)	I - EUR	08/01/24	(1,198,317)
EUR	187,326,309	USD	(208,122,021)	I - EUR (Perf)	08/01/24	(1,152,435)
EUR	156,466,299	USD	(173,836,139)	S - EUR	08/01/24	(962,584)
USD	68,458,831	GBP	(54,379,422)	I - GBP	08/01/24	(865,892)
USD	34,965,486	EUR	(32,343,641)	I - EUR (AIDiv)	08/01/24	(769,750)
USD	18,738,309	CHF	(16,337,082)	Q - CHF	08/01/24	(682,599)
USD	20,038,323	EUR	(18,556,794)	Q - EUR (AIDiv)	08/01/24	(464,360)
GBP	95,261,595	USD	(121,826,407)	S - GBP (AIDiv)	08/01/24	(383,710)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
USD	29,497,118	GBP	(23,430,667)	S - GBP	08/01/24	(373,087)
USD	13,856,278	EUR	(12,829,605)	C - EUR (AIDiv)	08/01/24	(318,657)
USD	11,888,834	EUR	(10,979,794)	C - EUR	08/01/24	(242,315)
GBP	54,379,422	USD	(69,543,880)	I - GBP	08/01/24	(219,157)
NOK	247,470,189	USD	(24,576,356)	I - NOK	08/01/24	(205,599)
EUR	31,901,779	USD	(35,443,301)	I - EUR (AIDiv)	08/01/24	(196,260)
USD	4,979,512	SEK	(52,139,384)	I - SEK	08/01/24	(195,174)
USD	6,113,073	EUR	(5,661,109)	B - EUR	08/01/24	(141,667)
USD	34,665,754	CHF	(29,288,116)	R - CHF	04/01/24	(136,335)
EUR	18,282,708	USD	(20,312,331)	Q - EUR (AIDiv)	08/01/24	(112,476)
GBP	23,392,806	USD	(29,916,215)	S - GBP	08/01/24	(94,276)
SEK	52,258,624	USD	(5,270,382)	I - SEK	08/01/24	(83,863)
EUR	12,548,111	USD	(13,941,118)	C - EUR (AIDiv)	08/01/24	(77,196)
USD	19,283,346	CHF	(16,291,954)	Q - CHF	04/01/24	(75,839)
USD	5,737,893	GBP	(4,558,232)	Q - GBP (QIDiv)	08/01/24	(73,095)
EUR	10,836,636	USD	(12,039,646)	C - EUR	08/01/24	(66,667)
USD	5,129,808	GBP	(4,074,799)	B - GBP	08/01/24	(64,884)
USD	4,577,701	GBP	(3,636,355)	C - GBP (AIDiv)	08/01/24	(58,046)
USD	608,933	NOK	(6,650,873)	R - NOK	08/01/24	(46,042)
USD	977,667	CHF	(852,391)	B - CHF	08/01/24	(35,623)
EUR	5,572,784	USD	(6,191,437)	B - EUR	08/01/24	(34,284)
USD	1,033,105	EUR	(956,722)	Q - EUR	08/01/24	(23,941)
GBP	4,519,193	USD	(5,779,433)	Q - GBP (QIDiv)	08/01/24	(18,213)
USD	769,706	EUR	(712,647)	B - EUR (AIDiv)	08/01/24	(17,670)
GBP	4,074,799	USD	(5,211,114)	B - GBP	08/01/24	(16,422)
USD	660,961	EUR	(612,026)	R - EUR	08/01/24	(15,243)
USD	369,751	CHF	(322,371)	C - CHF	08/01/24	(13,472)
GBP	3,048,317	USD	(3,898,383)	C - GBP (AIDiv)	08/01/24	(12,285)
EUR	942,591	USD	(1,047,231)	Q - EUR	08/01/24	(5,799)
NOK	6,506,050	USD	(646,118)	R - NOK	08/01/24	(5,405)
USD	369,596	GBP	(293,583)	X - GBP	08/01/24	(4,674)
USD	189,511	EUR	(175,506)	M - EUR	08/01/24	(4,399)
EUR	702,556	USD	(780,549)	B - EUR (AIDiv)	08/01/24	(4,322)
USD	1,008,900	CHF	(852,391)	B - CHF	04/01/24	(3,968)
EUR	602,982	USD	(669,921)	R - EUR	08/01/24	(3,710)
USD	381,563	CHF	(322,371)	C - CHF	04/01/24	(1,501)
USD	103,932	GBP	(82,557)	D - GBP (QIDiv)	08/01/24	(1,315)
GBP	293,583	USD	(375,453)	X - GBP	08/01/24	(1,183)
EUR	162,908	USD	(180,993)	M - EUR	08/01/24	(1,002)
USD	27,017	EUR	(25,021)	X - EUR	08/01/24	(627)
GBP	82,557	USD	(105,579)	D - GBP (QIDiv)	08/01/24	(333)
EUR	24,651	USD	(27,388)	X - EUR	08/01/24	(152)
USD	2,661	GBP	(2,114)	C - GBP	08/01/24	(34)
GBP	2,114	USD	(2,703)	C - GBP	08/01/24	(9)

Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt

(27,714,037)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
EUR	495,830	USD	(525,060)	18/01/24	22,999
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					22,999
USD	167,832	EUR	(157,432)	18/01/24	(6,183)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(6,183)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
EUR	103,824,697	USD	(112,114,224)	I - EUR (AIDiv)	08/01/24	2,597,664
EUR	304,181	USD	(328,468)	B - EUR	08/01/24	7,611
EUR	30,587	USD	(33,029)	R - EUR	08/01/24	765
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						2,606,040

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) EUR
EUR	202,384,986	USD	(215,412,922)	18/01/24	7,500,777
COP	104,086,712,281	USD	(24,565,018)	18/01/24	2,005,328
JPY	5,454,032,019	USD	(37,198,952)	18/01/24	1,430,274
MXN	244,395,597	USD	(13,210,273)	18/01/24	1,071,170
CLP	20,712,810,128	USD	(22,527,914)	18/01/24	1,060,385
CAD	30,863,487	USD	(22,500,000)	18/01/24	824,709
ILS	37,208,396	USD	(9,679,207)	18/01/24	594,055
PLN	73,344,537	EUR	(16,377,636)	18/01/24	493,370
CNY	135,330,069	USD	(18,630,000)	18/01/24	440,796
IDR	285,434,596,447	USD	(18,160,000)	18/01/24	320,940
TWD	285,136,945	USD	(9,040,000)	18/01/24	294,542
ZAR	172,954,484	USD	(9,180,000)	18/01/24	239,660
ZAR	94,617,000	EUR	(4,548,985)	18/01/24	125,566
MXN	287,731,000	EUR	(15,225,199)	18/01/24	106,423
GBP	15,746,354	EUR	(18,067,920)	18/01/24	94,133
CHF	3,903,035	EUR	(4,140,000)	18/01/24	62,270
HUF	3,671,169,040	EUR	(9,520,000)	18/01/24	57,615
CAD	6,100,000	EUR	(4,162,084)	18/01/24	24,121
EUR	3,727,790	CAD	(5,410,000)	18/01/24	15,107
EUR	3,433,322	JPY	(531,918,000)	18/01/24	11,649

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) EUR
JPY	650,006	EUR	(4,148)	04/01/24	26
EUR	–	JPY	(6)	04/01/24	0
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					16,772,916
USD	100,565,695	EUR	(94,167,230)	18/01/24	(3,185,380)
USD	33,014,504	COP	(140,995,377,236)	18/01/24	(2,952,674)
EUR	84,398,374	MXN	(1,624,241,464)	18/01/24	(2,148,630)
USD	27,260,000	JPY	(4,001,336,588)	18/01/24	(1,077,286)
USD	13,332,403	MXN	(244,395,597)	18/01/24	(960,681)
USD	9,140,000	ILS	(36,246,315)	18/01/24	(840,096)
USD	23,460,000	CLP	(21,190,551,648)	18/01/24	(711,673)
USD	18,462,864	CNY	(134,399,678)	18/01/24	(473,098)
EUR	27,931,240	ZAR	(574,862,399)	18/01/24	(469,825)
USD	8,950,000	ZAR	(170,311,396)	18/01/24	(317,160)
EUR	12,450,000	CHF	(11,841,158)	18/01/24	(298,988)
EUR	8,590,000	HUF	(3,396,847,258)	17/01/24	(273,689)
EUR	8,580,000	HUF	(3,386,628,600)	18/01/24	(255,285)
USD	7,366,220	CAD	(9,999,383)	18/01/24	(197,984)
GBP	21,787,286	EUR	(25,319,571)	18/01/24	(189,828)
EUR	78,139,765	GBP	(67,892,194)	18/01/24	(167,988)
EUR	16,810,000	PLN	(73,570,018)	18/01/24	(112,871)
USD	18,880,000	IDR	(291,995,739,948)	18/01/24	(54,587)
GBP	4,097	EUR	(4,730)	08/01/24	(2)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(14,687,725)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) EUR
JPY	34,252,149,907	EUR	(216,136,832)	S - JPY	09/01/24	3,961,468
CHF	4,160,563	EUR	(4,416,912)	I - CHF	08/01/24	59,594
EUR	2,246,253	USD	(2,422,211)	S - USD	08/01/24	53,930
NOK	3,353,326	EUR	(284,193)	I - NOK	08/01/24	14,699
CHF	553,707	EUR	(588,086)	B - CHF	08/01/24	7,669
EUR	313,475	USD	(338,716)	I - USD	08/01/24	6,906
CHF	324,447	EUR	(344,591)	S - CHF	08/01/24	4,494
EUR	237,198	USD	(259,974)	Q - USD	08/01/24	1,897
EUR	211,402	JPY	(32,740,028)	S - JPY	09/01/24	1,020
EUR	33,057	USD	(35,719)	R - USD	08/01/24	728
EUR	23,727	USD	(25,638)	B - USD	08/01/24	523
EUR	21,325	USD	(23,042)	C - USD	08/01/24	470
CHF	25,964	EUR	(27,547)	S - CHF (AIDiv)	08/01/24	389
EUR	16,409	USD	(17,731)	M - USD	08/01/24	361
CHF	10,831	EUR	(11,504)	Q - CHF	08/01/24	150
EUR	3,906	USD	(4,220)	I - USD (AIDiv)	08/01/24	86
EUR	2,696	USD	(2,913)	C - USD (AIDiv)	08/01/24	59
EUR	1,168	USD	(1,262)	R - USD (AIDiv)	08/01/24	26
EUR	26,163	CHF	(24,303)	I - CHF	08/01/24	15
EUR	269	USD	(291)	X - USD	08/01/24	6
EUR	3,810	CHF	(3,539)	B - CHF	08/01/24	2
EUR	2,133	CHF	(1,981)	S - CHF	08/01/24	1

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) EUR
EUR	36	GBP	(31)	S - GBP	08/01/24	0
EUR	72	CHF	(67)	Q - CHF	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						4,114,493
USD	44,471,177	EUR	(41,194,534)	I - USD	08/01/24	(944,062)
USD	16,796,033	EUR	(15,559,578)	S - USD	08/01/24	(357,636)
USD	4,508,091	EUR	(4,176,214)	R - USD	08/01/24	(95,979)
USD	3,283,672	EUR	(3,041,961)	B - USD	08/01/24	(69,938)
USD	2,848,080	EUR	(2,638,406)	C - USD	08/01/24	(60,634)
GBP	3,329,957	EUR	(3,885,274)	C - GBP	08/01/24	(43,035)
USD	1,864,974	EUR	(1,727,680)	M - USD	08/01/24	(39,709)
USD	543,323	EUR	(503,329)	I - USD (AIDiv)	08/01/24	(11,572)
USD	375,034	EUR	(347,428)	C - USD (AIDiv)	08/01/24	(7,988)
GBP	448,830	EUR	(523,679)	D - GBP (QIDiv)	08/01/24	(5,800)
USD	259,974	EUR	(240,837)	Q - USD	08/01/24	(5,536)
GBP	408,289	EUR	(476,377)	C - GBP (AIDiv)	08/01/24	(5,276)
USD	163,844	EUR	(151,783)	R - USD (AIDiv)	08/01/24	(3,490)
GBP	152,473	EUR	(177,900)	X - GBP	08/01/24	(1,970)
GBP	119,820	EUR	(139,802)	B - GBP	08/01/24	(1,549)
EUR	256,825	USD	(285,323)	I - USD	08/01/24	(1,419)
EUR	20,217	NOK	(238,956)	I - NOK	08/01/24	(1,082)
USD	37,539	EUR	(34,776)	X - USD	08/01/24	(800)
EUR	79,939	USD	(88,810)	S - USD	08/01/24	(442)
EUR	47,520	JPY	(7,459,989)	S - JPY	09/01/24	(416)
GBP	10,414	EUR	(12,151)	Q - GBP (AIDiv)	08/01/24	(135)
GBP	9,937	EUR	(11,594)	S - GBP (AIDiv)	08/01/24	(128)
EUR	19,205	USD	(21,336)	B - USD	08/01/24	(106)
EUR	24,246	GBP	(21,096)	C - GBP	08/01/24	(96)
EUR	16,225	USD	(18,025)	C - USD	08/01/24	(90)
GBP	5,731	EUR	(6,687)	S - GBP	08/01/24	(73)
EUR	10,787	USD	(11,984)	M - USD	08/01/24	(60)
EUR	3,147	USD	(3,496)	I - USD (AIDiv)	08/01/24	(17)
EUR	3,353	GBP	(2,917)	D - GBP (QIDiv)	08/01/24	(13)
EUR	843	CHF	(796)	I - CHF	08/01/24	(13)
EUR	2,138	USD	(2,375)	C - USD (AIDiv)	08/01/24	(12)
EUR	2,973	GBP	(2,587)	C - GBP (AIDiv)	08/01/24	(12)
EUR	895	GBP	(779)	B - GBP	08/01/24	(3)
EUR	183	CHF	(172)	S - CHF (AIDiv)	08/01/24	(3)
EUR	71	GBP	(62)	S - GBP (AIDiv)	08/01/24	0
EUR	75	GBP	(66)	Q - GBP (AIDiv)	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(1,659,094)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
USD	319,819	EUR	(300,000)	18/01/24	(11,782)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(11,782)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
EUR	61,175,400	USD	(66,053,508)	I - EUR	08/01/24	1,536,822
NOK	9,963,676	USD	(929,783)	I - NOK	08/01/24	51,434
EUR	1,084,387	USD	(1,170,993)	C - EUR	08/01/24	27,105
NOK	4,418,751	USD	(422,677)	I - NOK	04/01/24	12,435
USD	438,828	NOK	(4,418,751)	I - NOK	04/01/24	3,716
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						1,631,512
USD	929,783	NOK	(9,963,676)	I - NOK	08/01/24	(51,436)
NOK	4,418,751	USD	(438,828)	I - NOK	08/01/24	(3,671)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(55,107)

BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
AUD	233,363	USD	(159,076)	08/01/24	185
EUR	20,304	USD	(22,426)	08/01/24	7
USD	117	EUR	(106)	08/01/24	0
USD	94	GBP	(74)	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					192
USD	499,365,243	EUR	(467,024,946)	18/01/24	(16,854,974)
USD	24,601,804	GBP	(19,763,567)	18/01/24	(595,000)
USD	6,314,075	EUR	(6,000,000)	17/01/24	(317,657)
GBP	4,941,530	USD	(6,301,192)	08/01/24	(1,563)
CHF	42,022	USD	(49,986)	08/01/24	(32)
USD	2,172	EUR	(1,966)	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(17,769,226)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
GBP	215,935,414	USD	(271,834,827)	S-GBP (QIDiv)	08/01/24	3,446,928
GBP	212,409,127	USD	(267,441,858)	S-GBP (QIDiv)	04/01/24	3,338,601
GBP	196,101,558	USD	(246,815,163)	Q - GBP (QIDiv)	08/01/24	3,181,724
GBP	196,334,653	USD	(247,143,206)	Q - GBP (QIDiv)	04/01/24	3,145,413
JPY	14,962,582,989	USD	(103,783,255)	S - JPY	09/01/24	2,449,844

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
GBP	198,042,223	USD	(250,045,934)	I - GBP	08/01/24	2,424,977
GBP	198,935,952	USD	(251,193,866)	I - GBP	04/01/24	2,410,906
EUR	88,515,034	USD	(95,578,271)	I - EUR	08/01/24	2,218,562
EUR	86,911,262	USD	(93,846,931)	I - EUR	04/01/24	2,163,318
JPY	7,481,291,493	USD	(51,079,197)	S - JPY	04/01/24	1,995,498
USD	271,642,367	GBP	(212,409,127)	S-GBP (QIDiv)	04/01/24	861,909
USD	254,412,010	GBP	(198,935,952)	I - GBP	04/01/24	807,238
USD	251,085,302	GBP	(196,334,653)	Q - GBP (QIDiv)	04/01/24	796,682
EUR	22,934,783	USD	(24,764,911)	I - EUR (AIDiv)	08/01/24	574,843
EUR	22,701,643	USD	(24,513,173)	Q - EUR (AIDiv)	08/01/24	568,993
EUR	22,519,238	USD	(24,316,312)	I - EUR (AIDiv)	04/01/24	560,529
EUR	22,290,332	USD	(24,069,144)	Q - EUR (AIDiv)	04/01/24	554,826
USD	96,559,568	EUR	(86,911,262)	I - EUR	04/01/24	549,319
AUD	20,302,250	USD	(13,371,967)	S - AUD (QIDiv)	08/01/24	483,519
CHF	20,195,967	USD	(23,527,318)	M - CHF	08/01/24	480,887
AUD	20,104,210	USD	(13,241,776)	S - AUD (QIDiv)	04/01/24	476,777
EUR	17,899,046	USD	(19,327,341)	Q - EUR	08/01/24	448,621
EUR	17,623,819	USD	(19,031,773)	Q - EUR	04/01/24	437,134
CHF	9,875,954	USD	(11,325,495)	M - CHF	04/01/24	409,771
CAD	26,708,845	USD	(19,969,796)	Y - CAD	08/01/24	287,274
CAD	13,300,011	USD	(9,814,365)	Y - CAD	04/01/24	272,259
GBP	15,297,545	USD	(19,256,002)	Y - GBP (MIDiv)	08/01/24	245,825
GBP	14,870,783	USD	(18,718,395)	Y - GBP (MIDiv)	04/01/24	238,971
EUR	9,282,623	USD	(10,023,350)	C - EUR	08/01/24	232,659
EUR	9,057,597	USD	(9,779,281)	C - EUR	04/01/24	226,581
CHF	7,232,015	USD	(8,426,580)	Q - CHF (QIDiv)	08/01/24	170,568
CHF	3,606,703	USD	(4,136,234)	Q - CHF (QIDiv)	04/01/24	149,491
USD	25,019,173	EUR	(22,519,238)	I - EUR (AIDiv)	04/01/24	142,332
USD	24,764,855	EUR	(22,290,332)	Q - EUR (AIDiv)	04/01/24	140,885
EUR	4,939,402	USD	(5,335,498)	S - EUR	08/01/24	121,857
EUR	4,805,340	USD	(5,189,715)	S - EUR	04/01/24	118,710
EUR	4,751,437	USD	(5,132,613)	M - EUR	08/01/24	117,065
EUR	4,641,649	USD	(5,013,553)	M - EUR	04/01/24	114,044
USD	19,580,297	EUR	(17,623,819)	Q - EUR	04/01/24	111,391
EUR	3,886,907	USD	(4,199,685)	B - EUR	08/01/24	94,808
EUR	3,826,976	USD	(4,134,996)	B - EUR	04/01/24	92,637
USD	19,017,708	GBP	(14,870,783)	Y - GBP (MIDiv)	04/01/24	60,342
USD	10,063,111	EUR	(9,057,597)	C - EUR	04/01/24	57,248
CHF	2,460,789	USD	(2,868,066)	S - CHF	08/01/24	57,228
USD	13,775,495	AUD	(20,104,210)	S - AUD (QIDiv)	04/01/24	56,942
CHF	1,230,331	USD	(1,411,708)	S - CHF	04/01/24	50,254
EUR	1,848,108	USD	(1,995,775)	R - EUR	08/01/24	46,129
EUR	1,816,392	USD	(1,961,537)	R - EUR	04/01/24	45,018
EUR	1,792,480	USD	(1,935,512)	S - EUR (QIDiv)	08/01/24	44,930
EUR	1,682,582	USD	(1,815,799)	S - EUR (QIDiv)	04/01/24	42,937
GBP	2,081,679	USD	(2,620,337)	Q - GBP	08/01/24	33,458
GBP	2,041,342	USD	(2,569,872)	Q - GBP	04/01/24	32,443
USD	5,338,797	EUR	(4,805,340)	S - EUR	04/01/24	30,372
USD	5,156,934	EUR	(4,641,649)	M - EUR	04/01/24	29,337
USD	4,251,821	EUR	(3,826,976)	B - EUR	04/01/24	24,188
EUR	897,912	USD	(969,539)	C - EUR (AIDiv)	08/01/24	22,530
EUR	806,332	USD	(870,653)	C - EUR (AIDiv)	04/01/24	20,097
USD	2,018,036	EUR	(1,816,392)	R - EUR	04/01/24	11,480
USD	1,869,371	EUR	(1,682,582)	S - EUR (QIDiv)	04/01/24	10,635
USD	2,610,598	GBP	(2,041,342)	Q - GBP	04/01/24	8,283
USD	895,846	EUR	(806,332)	C - EUR (AIDiv)	04/01/24	5,096
GBP	252,416	USD	(317,732)	S - GBP	08/01/24	4,056

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
EUR	106,976	USD	(115,513)	X - EUR	08/01/24	2,682
EUR	105,038	USD	(113,421)	X - EUR	04/01/24	2,614
CHF	64,568	USD	(75,236)	R - CHF	08/01/24	1,519
GBP	89,926	USD	(113,195)	X - GBP	08/01/24	1,445
GBP	90,070	USD	(113,393)	X - GBP	04/01/24	1,429
CHF	32,284	USD	(37,025)	R - CHF	04/01/24	1,337
USD	116,699	EUR	(105,038)	X - EUR	04/01/24	664
EUR	24,357	USD	(26,302)	R - EUR (QIDiv)	08/01/24	609
EUR	24,136	USD	(26,064)	R - EUR (QIDiv)	04/01/24	599
CHF	21,012	USD	(24,484)	R - CHF (QIDiv)	08/01/24	495
CHF	10,506	USD	(12,049)	R - CHF (QIDiv)	04/01/24	435
CHF	18,109	USD	(21,101)	R - CHF (AIDiv)	08/01/24	427
CHF	9,055	USD	(10,384)	R - CHF (AIDiv)	04/01/24	375
USD	115,187	GBP	(90,070)	X - GBP	04/01/24	365
USD	26,816	EUR	(24,136)	R - EUR (QIDiv)	04/01/24	153
GBP	9,241	USD	(11,632)	C - GBP	08/01/24	148
GBP	9,255	USD	(11,652)	C - GBP	04/01/24	147
GBP	8,294	USD	(10,440)	Y - GBP	08/01/24	133
GBP	8,308	USD	(10,459)	Y - GBP	04/01/24	132
GBP	7,098	USD	(8,935)	R - GBP	08/01/24	114
GBP	7,108	USD	(8,949)	R - GBP	04/01/24	113
GBP	7,009	USD	(8,823)	R - GBP (QIDiv)	08/01/24	112
GBP	7,019	USD	(8,837)	R - GBP (QIDiv)	04/01/24	111
USD	11,836	GBP	(9,255)	C - GBP	04/01/24	38
USD	10,624	GBP	(8,308)	Y - GBP	04/01/24	34
USD	9,090	GBP	(7,108)	R - GBP	04/01/24	29
USD	8,977	GBP	(7,019)	R - GBP (QIDiv)	04/01/24	28
USD	4,443	EUR	(4,000)	S - EUR	08/01/24	24
USD	482	CHF	(403)	M - CHF	08/01/24	3
USD	288	GBP	(225)	S-GBP (QIDiv)	08/01/24	1
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						38,373,494
USD	274,617,042	GBP	(218,114,798)	S-GBP (QIDiv)	08/01/24	(3,443,066)
USD	249,186,955	GBP	(197,959,477)	Q - GBP (QIDiv)	08/01/24	(3,178,470)
USD	251,566,763	GBP	(199,233,549)	I - GBP	08/01/24	(2,422,891)
USD	95,578,272	EUR	(88,515,034)	I - EUR	08/01/24	(2,218,563)
USD	51,078,021	JPY	(7,481,291,493)	S - JPY	09/01/24	(2,038,529)
GBP	216,465,764	USD	(276,822,288)	S-GBP (QIDiv)	08/01/24	(864,423)
GBP	201,691,593	USD	(257,930,873)	I - GBP	08/01/24	(807,621)
GBP	199,781,432	USD	(255,486,479)	Q - GBP (QIDiv)	08/01/24	(798,365)
USD	24,764,911	EUR	(22,934,783)	I - EUR (AIDiv)	08/01/24	(574,843)
USD	24,513,173	EUR	(22,701,643)	Q - EUR (AIDiv)	08/01/24	(568,994)
EUR	87,608,841	USD	(97,334,553)	I - EUR	08/01/24	(538,937)
USD	13,371,967	AUD	(20,302,250)	S - AUD (QIDiv)	08/01/24	(483,519)
USD	19,382,109	EUR	(17,948,342)	Q - EUR	08/01/24	(448,319)
USD	11,838,024	CHF	(10,320,013)	M - CHF	08/01/24	(430,020)
USD	52,705,235	JPY	(7,481,291,493)	S - JPY	04/01/24	(369,460)
USD	9,814,215	CAD	(13,300,011)	Y - CAD	08/01/24	(273,052)
USD	19,439,593	GBP	(15,441,358)	Y - GBP (MIDiv)	08/01/24	(245,572)
USD	10,023,350	EUR	(9,282,623)	C - EUR	08/01/24	(232,660)
USD	4,157,644	CHF	(3,625,312)	Q - CHF (QIDiv)	08/01/24	(151,990)
EUR	22,699,985	USD	(25,219,976)	I - EUR (AIDiv)	08/01/24	(139,642)
EUR	22,469,706	USD	(24,964,134)	Q - EUR (AIDiv)	08/01/24	(138,226)
USD	5,335,498	EUR	(4,939,402)	S - EUR	08/01/24	(121,856)
USD	5,132,613	EUR	(4,751,437)	M - EUR	08/01/24	(117,065)
EUR	17,814,846	USD	(19,792,524)	Q - EUR	08/01/24	(109,590)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
USD	4,199,685	EUR	(3,886,907)	B - EUR	08/01/24	(94,809)
GBP	15,137,506	USD	(19,358,285)	Y - GBP (MIDiv)	08/01/24	(60,481)
EUR	9,130,440	USD	(10,144,036)	C - EUR	08/01/24	(56,168)
AUD	20,266,000	USD	(13,886,538)	S - AUD (QIDiv)	08/01/24	(55,791)
USD	1,411,682	CHF	(1,230,331)	S - CHF	08/01/24	(50,889)
USD	1,995,775	EUR	(1,848,108)	R - EUR	08/01/24	(46,129)
USD	11,689,294	CHF	(9,875,954)	M - CHF	04/01/24	(45,972)
USD	1,935,512	EUR	(1,792,480)	S - EUR (QIDiv)	08/01/24	(44,930)
USD	2,644,631	GBP	(2,100,709)	Q - GBP	08/01/24	(33,424)
EUR	4,844,310	USD	(5,382,091)	S - EUR	08/01/24	(29,801)
EUR	4,678,644	USD	(5,198,034)	M - EUR	08/01/24	(28,782)
EUR	3,857,328	USD	(4,285,541)	B - EUR	08/01/24	(23,729)
USD	969,539	EUR	(897,912)	C - EUR (AIDiv)	08/01/24	(22,530)
USD	4,268,936	CHF	(3,606,703)	Q - CHF (QIDiv)	04/01/24	(16,789)
USD	10,073,051	CAD	(13,300,011)	Y - CAD	04/01/24	(13,574)
EUR	1,830,765	USD	(2,034,004)	R - EUR	08/01/24	(11,262)
EUR	1,696,172	USD	(1,884,468)	S - EUR (QIDiv)	08/01/24	(10,434)
GBP	2,076,892	USD	(2,655,992)	Q - GBP	08/01/24	(8,300)
USD	1,456,234	CHF	(1,230,331)	S - CHF	04/01/24	(5,727)
EUR	812,807	USD	(903,039)	C - EUR (AIDiv)	08/01/24	(5,001)
USD	115,513	EUR	(106,976)	X - EUR	08/01/24	(2,681)
CHF	282,712	USD	(338,239)	M - CHF	08/01/24	(2,161)
USD	114,274	GBP	(90,771)	X - GBP	08/01/24	(1,444)
USD	37,024	CHF	(32,284)	R - CHF	08/01/24	(1,354)
EUR	105,897	USD	(117,652)	X - EUR	08/01/24	(651)
USD	26,302	EUR	(24,357)	R - EUR (QIDiv)	08/01/24	(608)
USD	12,049	CHF	(10,506)	R - CHF (QIDiv)	08/01/24	(440)
CHF	54,631	USD	(65,358)	S - CHF	08/01/24	(416)
USD	10,384	CHF	(9,055)	R - CHF (AIDiv)	08/01/24	(380)
GBP	91,655	USD	(117,212)	X - GBP	08/01/24	(366)
CHF	28,672	USD	(34,311)	Q - CHF (QIDiv)	08/01/24	(227)
USD	38,212	CHF	(32,284)	R - CHF	04/01/24	(150)
EUR	24,327	USD	(27,027)	R - EUR (QIDiv)	08/01/24	(149)
USD	11,742	GBP	(9,327)	C - GBP	08/01/24	(148)
JPY	59,477,722	USD	(422,422)	S - JPY	09/01/24	(135)
USD	10,540	GBP	(8,372)	Y - GBP	08/01/24	(133)
USD	9,019	GBP	(7,164)	R - GBP	08/01/24	(114)
USD	8,906	GBP	(7,074)	R - GBP (QIDiv)	08/01/24	(113)
USD	12,435	CHF	(10,506)	R - CHF (QIDiv)	04/01/24	(49)
USD	10,717	CHF	(9,055)	R - CHF (AIDiv)	04/01/24	(42)
GBP	9,416	USD	(12,042)	C - GBP	08/01/24	(37)
GBP	8,454	USD	(10,811)	Y - GBP	08/01/24	(33)
USD	2,478	GBP	(1,968)	S - GBP	08/01/24	(31)
GBP	7,230	USD	(9,246)	R - GBP	08/01/24	(29)
GBP	7,140	USD	(9,131)	R - GBP (QIDiv)	08/01/24	(28)
GBP	4,412	USD	(5,633)	S - GBP	08/01/24	(9)
CHF	252	USD	(302)	R - CHF	08/01/24	(2)
CHF	82	USD	(98)	R - CHF (QIDiv)	08/01/24	(1)
CHF	71	USD	(85)	R - CHF (AIDiv)	08/01/24	(1)

Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt

(21,392,127)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
EUR	29,189,592	USD	(31,584,229)	18/01/24	680,122
PLN	33,887,991	USD	(8,184,010)	18/01/24	432,162
THB	233,525,494	USD	(6,508,349)	18/01/24	342,766
MXN	109,705,545	USD	(6,142,515)	18/01/24	318,871
CZK	132,521,236	USD	(5,780,084)	18/01/24	146,387
GBP	2,682,704	USD	(3,273,885)	18/01/24	146,326
PEN	25,763,191	USD	(6,814,743)	18/01/24	140,004
KRW	8,686,577,751	USD	(6,564,940)	18/01/24	137,961
JPY	584,929,831	USD	(4,047,863)	18/01/24	111,169
MYR	19,310,859	USD	(4,109,900)	18/01/24	104,649
CNY	47,039,737	USD	(6,543,139)	18/01/24	101,871
TWD	102,799,535	USD	(3,278,583)	18/01/24	97,955
CLP	3,110,017,289	USD	(3,469,767)	18/01/24	88,778
ZAR	58,526,781	USD	(3,130,161)	18/01/24	65,942
MYR	12,068,529	USD	(2,577,754)	18/01/24	56,173
BRL	13,372,267	USD	(2,692,614)	02/02/24	55,461
IDR	72,624,416,215	USD	(4,669,122)	18/01/24	41,673
COP	383,649,650	USD	(95,434)	18/01/24	3,280
USD	433,204	EUR	(389,554)	18/01/24	2,616
USD	572,293	GBP	(448,021)	18/01/24	1,106
RON	229,853	USD	(50,305)	18/01/24	724
INR	159,101,682	USD	(1,910,000)	18/01/24	560
USD	59,842	CLP	(52,149,909)	18/01/24	171

Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt

3,076,727

USD	201,924,252	EUR	(190,007,411)	18/01/24	(8,098,078)
USD	21,164,052	GBP	(17,294,605)	18/01/24	(885,043)
USD	8,971,605	MXN	(162,843,319)	18/01/24	(619,465)
USD	6,489,186	COP	(27,194,511,451)	18/01/24	(507,992)
USD	11,200,540	BRL	(56,252,475)	02/02/24	(359,653)
USD	5,482,120	ZAR	(103,596,881)	18/01/24	(175,228)
USD	2,114,294	CLP	(1,974,906,710)	18/01/24	(145,435)
USD	5,109,793	RON	(23,625,004)	18/01/24	(135,108)
USD	1,894,095	HUF	(697,263,362)	18/01/24	(116,595)
USD	4,151,926	PEN	(15,728,282)	18/01/24	(93,907)
USD	1,950,000	CZK	(45,391,466)	18/01/24	(79,948)
USD	4,723,095	IDR	(73,483,921,032)	18/01/24	(43,450)
USD	1,943,776	PLN	(7,805,756)	18/01/24	(40,872)
USD	877,867	JPY	(127,743,968)	18/01/24	(30,432)
USD	181,767	KRW	(245,609,387)	18/01/24	(7,755)
USD	1,901,000	INR	(158,908,392)	18/01/24	(7,238)
USD	97,793	THB	(3,547,138)	18/01/24	(6,272)
USD	103,333	MYR	(490,077)	18/01/24	(3,625)
USD	1,059,534	HKD	(8,281,922)	18/01/24	(1,455)
CZK	1,398,391	USD	(63,134)	18/01/24	(597)
KRW	137,025,530	USD	(106,265)	18/01/24	(531)
GBP	1,378,543	USD	(1,757,849)	08/01/24	(436)
HKD	4,100,000	USD	(525,272)	18/01/24	(25)
USD	3,293	GBP	(2,583)	08/01/24	0

Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt

(11,359,140)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
GBP	259,501,344	USD	(326,672,454)	I - GBP	08/01/24	4,148,620
GBP	91,704,604	USD	(115,442,559)	I - GBP (QIDiv)	08/01/24	1,465,567
AUD	50,447,673	USD	(33,232,858)	I - AUD	08/01/24	1,195,693
JPY	2,751,205,634	USD	(18,783,446)	S - JPY	09/01/24	749,886
EUR	9,729,493	USD	(10,506,652)	I - EUR	08/01/24	243,089
NOK	4,327,847	USD	(396,158)	M - NOK	08/01/24	30,047
GBP	1,666,401	USD	(2,100,647)	C - GBP (QIDiv)	08/01/24	23,737
EUR	537,862	USD	(580,838)	C - EUR	08/01/24	13,425
NOK	588,153	USD	(53,840)	I - NOK	08/01/24	4,081
USD	–	NOK	(1)	M - NOK	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						7,874,145
USD	10,078,320	GBP	(8,000,000)	I - GBP	08/01/24	(120,350)
GBP	2,117,708	USD	(2,703,434)	I - GBP	08/01/24	(3,709)
USD	149,352	EUR	(138,222)	I - EUR	08/01/24	(3,364)
USD	24,952	NOK	(273,354)	M - NOK	08/01/24	(1,968)
GBP	760,968	USD	(971,440)	I - GBP (QIDiv)	08/01/24	(1,333)
USD	8,405	EUR	(7,778)	C - EUR	08/01/24	(189)
USD	1,431	NOK	(15,646)	I - NOK	08/01/24	(110)
GBP	12,137	USD	(15,494)	C - GBP (QIDiv)	08/01/24	(21)
USD	1,222	GBP	(968)	C - GBP (QIDiv)	08/01/24	(13)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(131,057)

BlueBay Funds – BlueBay Financial Capital Bond Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
EUR	92,917,289	USD	(99,361,730)	18/01/24	3,343,239
GBP	32,050,000	USD	(39,968,716)	18/01/24	892,206
JPY	793,502,389	USD	(5,412,438)	18/01/24	229,611
USD	9,636,318	GBP	(7,551,497)	18/01/24	8,826
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					4,473,882
USD	1,063,433,181	EUR	(1,000,164,362)	18/01/24	(42,086,059)
USD	328,375,715	GBP	(268,241,755)	18/01/24	(13,608,856)
USD	6,445,846	EUR	(6,123,002)	17/01/24	(321,838)
USD	5,064,422	JPY	(757,085,040)	18/01/24	(318,688)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(56,335,441)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Financial Capital Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
EUR	815,233,145	USD	(888,604,084)	I - EUR	08/01/24	12,115,452
EUR	137,266,074	USD	(149,620,977)	S - EUR	08/01/24	2,038,993
GBP	110,313,518	USD	(138,860,333)	K - GBP (AIDiv)	08/01/24	1,771,065
SEK	464,597,671	USD	(44,969,169)	I - SEK	08/01/24	1,140,826
GBP	65,857,910	USD	(82,902,369)	C - GBP (AIDiv)	08/01/24	1,055,515
EUR	48,731,363	USD	(53,121,612)	Q - EUR	08/01/24	719,783
EUR	45,843,130	USD	(49,969,153)	K - EUR	08/01/24	681,147
EUR	33,647,443	USD	(36,673,078)	M - EUR	08/01/24	502,680
GBP	30,689,553	USD	(38,631,415)	K - GBP	08/01/24	492,663
GBP	30,472,486	USD	(38,358,142)	G - GBP	08/01/24	489,210
CHF	13,226,509	USD	(15,237,833)	C - CHF (AIDiv)	08/01/24	485,345
GBP	24,928,581	USD	(31,379,599)	I - GBP (AIDiv)	08/01/24	400,198
EUR	24,959,816	USD	(27,189,185)	C - EUR	08/01/24	387,949
NOK	55,739,875	USD	(5,214,248)	I - NOK	08/01/24	274,990
GBP	13,655,036	USD	(17,189,480)	S - GBP	08/01/24	218,420
EUR	16,169,939	USD	(17,667,335)	S - EUR (AIDiv)	08/01/24	198,206
CHF	4,418,837	USD	(5,091,017)	Q - CHF	08/01/24	161,931
CHF	4,185,804	USD	(4,822,150)	M - CHF	08/01/24	153,774
EUR	7,067,647	USD	(7,703,713)	C - EUR (AIDiv)	08/01/24	105,057
GBP	6,272,358	USD	(7,895,509)	G - GBP (AIDiv)	08/01/24	100,706
EUR	6,581,442	USD	(7,173,766)	G - EUR (AIDiv)	08/01/24	97,815
GBP	4,436,808	USD	(5,584,963)	C - GBP	08/01/24	71,228
EUR	3,942,294	USD	(4,297,102)	X - EUR	08/01/24	58,585
EUR	3,311,749	USD	(3,609,799)	R - EUR	08/01/24	49,224
GBP	2,943,415	USD	(3,705,285)	X - GBP	08/01/24	47,080
SEK	17,371,284	USD	(1,681,360)	R - SEK	08/01/24	42,691
SEK	13,100,623	USD	(1,268,031)	Q - SEK	08/01/24	32,168
GBP	915,195	USD	(1,152,210)	M - GBP	08/01/24	14,511
EUR	450,858	USD	(491,435)	M - EUR (AIDiv)	08/01/24	6,700
EUR	417,387	USD	(454,951)	R - EUR (AIDiv)	08/01/24	6,204
USD	49,690	SEK	(492,702)	R - SEK	08/01/24	791
USD	124,173	EUR	(111,769)	Q - EUR	08/01/24	683
USD	100,032	GBP	(78,264)	C - GBP (AIDiv)	08/01/24	259
USD	117,217	GBP	(91,839)	G - GBP	08/01/24	138
USD	6,942	EUR	(6,248)	C - EUR	08/01/24	38
USD	19,624	GBP	(15,375)	C - GBP	08/01/24	23
USD	761	GBP	(596)	G - GBP (AIDiv)	08/01/24	1
USD	230	GBP	(180)	K - GBP	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						23,922,049
USD	449,545,319	EUR	(416,301,959)	I - EUR	08/01/24	(10,410,594)
USD	138,670,256	GBP	(110,168,390)	K - GBP (AIDiv)	08/01/24	(1,776,126)
USD	73,550,316	EUR	(68,135,056)	S - EUR	08/01/24	(1,729,469)
USD	81,442,872	GBP	(64,708,861)	C - GBP (AIDiv)	08/01/24	(1,050,169)
USD	22,009,101	SEK	(230,597,170)	I - SEK	08/01/24	(877,012)
USD	25,773,284	EUR	(23,873,908)	Q - EUR	08/01/24	(604,072)
USD	24,555,222	EUR	(22,747,667)	K - EUR	08/01/24	(577,795)
USD	37,998,287	GBP	(30,191,098)	K - GBP	08/01/24	(490,342)
USD	37,892,409	GBP	(30,106,535)	G - GBP	08/01/24	(488,418)
USD	18,189,703	EUR	(16,849,822)	M - EUR	08/01/24	(427,013)
USD	30,870,500	GBP	(24,527,870)	I - GBP (AIDiv)	08/01/24	(398,457)
USD	14,426,066	EUR	(13,362,139)	C - EUR	08/01/24	(337,244)
USD	7,520,358	CHF	(6,558,748)	C - CHF (AIDiv)	08/01/24	(276,435)
USD	17,001,173	GBP	(13,506,551)	S - GBP	08/01/24	(217,434)
USD	2,538,247	NOK	(27,760,724)	I - NOK	08/01/24	(195,617)
USD	8,722,528	EUR	(8,041,420)	S - EUR (AIDiv)	08/01/24	(162,126)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Financial Capital Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
GBP	106,973,633	USD	(136,529,004)	K - GBP (AIDiv)	08/01/24	(155,405)
GBP	64,264,178	USD	(82,019,505)	C - GBP (AIDiv)	08/01/24	(93,361)
USD	2,506,318	CHF	(2,185,819)	Q - CHF	08/01/24	(92,100)
USD	2,499,555	CHF	(2,178,295)	M - CHF	08/01/24	(89,920)
USD	3,791,768	EUR	(3,512,608)	C - EUR (AIDiv)	08/01/24	(89,176)
USD	3,526,654	EUR	(3,267,050)	G - EUR (AIDiv)	08/01/24	(82,983)
USD	5,900,262	GBP	(4,684,108)	C - GBP	08/01/24	(71,197)
USD	2,112,164	EUR	(1,956,684)	X - EUR	08/01/24	(49,701)
USD	3,638,415	GBP	(2,890,782)	X - GBP	08/01/24	(46,852)
GBP	30,111,391	USD	(38,430,766)	K - GBP	08/01/24	(43,748)
GBP	29,828,429	USD	(38,069,643)	G - GBP	08/01/24	(43,356)
USD	1,776,007	EUR	(1,645,272)	R - EUR	08/01/24	(41,792)
GBP	24,472,331	USD	(31,233,705)	I - GBP (AIDiv)	08/01/24	(35,552)
USD	823,639	SEK	(8,629,793)	R - SEK	08/01/24	(32,844)
USD	620,605	SEK	(6,502,299)	Q - SEK	08/01/24	(24,729)
GBP	13,381,241	USD	(17,078,298)	S - GBP	08/01/24	(19,439)
USD	1,100,522	GBP	(874,409)	M - GBP	08/01/24	(14,205)
GBP	4,289,519	USD	(5,474,655)	C - GBP	08/01/24	(6,232)
USD	241,565	EUR	(223,783)	M - EUR (AIDiv)	08/01/24	(5,684)
USD	223,834	EUR	(207,357)	R - EUR (AIDiv)	08/01/24	(5,267)
GBP	2,884,251	USD	(3,681,130)	X - GBP	08/01/24	(4,190)
USD	114,637	GBP	(91,135)	G - GBP (AIDiv)	08/01/24	(1,545)
GBP	872,429	USD	(1,113,470)	M - GBP	08/01/24	(1,267)
EUR	18,708	USD	(20,781)	K - EUR	08/01/24	(111)
EUR	500	USD	(555)	M - EUR	08/01/24	(3)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(21,068,982)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
JPY	18,445,532,297	USD	(124,938,286)	18/01/24	6,215,194
CAD	85,184,463	USD	(62,436,980)	18/01/24	2,179,922
EUR	99,139,139	USD	(107,631,123)	18/01/24	1,951,092
ILS	57,853,091	USD	(15,022,797)	18/01/24	1,047,778
MXN	387,760,944	USD	(21,832,834)	18/01/24	1,005,330
AUD	24,809,461	USD	(15,961,554)	18/01/24	975,995
COP	50,527,868,801	USD	(12,080,000)	18/01/24	920,876
PLN	79,948,146	EUR	(17,580,000)	18/01/24	895,336
CLP	15,048,718,872	USD	(16,420,246)	18/01/24	798,803
CNY	248,069,155	USD	(34,444,350)	18/01/24	598,829
SEK	94,504,431	EUR	(8,111,782)	18/01/24	417,162
KRW	14,562,746,744	USD	(10,839,338)	18/01/24	397,844
NOK	113,986,975	EUR	(9,847,163)	18/01/24	344,032
CHF	4,141,670	USD	(4,598,080)	18/01/24	330,842
TWD	305,997,426	USD	(9,720,000)	18/01/24	330,748
ZAR	285,090,084	USD	(15,256,827)	18/01/24	311,728
GBP	9,279,653	USD	(11,532,027)	18/01/24	298,713
SEK	35,566,254	USD	(3,265,665)	18/01/24	265,737
NZD	4,399,904	USD	(2,614,840)	18/01/24	171,129

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
IDR	133,118,914,977	USD	(8,470,000)	18/01/24	164,779
CHF	4,682,923	EUR	(4,960,000)	18/01/24	90,584
MYR	13,647,429	USD	(2,902,720)	18/01/24	75,798
DKK	11,943,366	USD	(1,699,791)	18/01/24	71,446
GBP	6,538,156	EUR	(7,490,000)	18/01/24	56,594
SGD	2,487,791	USD	(1,834,009)	18/01/24	53,346
NOK	6,933,925	USD	(633,425)	18/01/24	49,613
CZK	26,133,629	USD	(1,125,104)	18/01/24	43,616
HUF	213,614,867	USD	(574,823)	18/01/24	41,176
EUR	6,100,000	GBP	(5,263,008)	18/01/24	32,689
HUF	1,561,789,350	EUR	(4,050,000)	18/01/24	27,100
RON	2,422,529	USD	(517,077)	18/01/24	20,740
USD	4,347,805	CNY	(30,706,881)	18/01/24	10,036
PEN	884,265	USD	(230,864)	18/01/24	7,842
EUR	700,000	HUF	(266,194,950)	18/01/24	6,112
USD	387,500	EUR	(350,000)	18/01/24	632
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					20,209,193
USD	296,047,622	EUR	(276,766,622)	18/01/24	(9,872,921)
USD	102,214,171	MXN	(1,820,166,690)	18/01/24	(4,989,161)
USD	39,665,712	ZAR	(757,953,445)	18/01/24	(1,725,556)
USD	37,310,355	JPY	(5,475,830,340)	18/01/24	(1,624,505)
USD	13,480,000	ILS	(53,457,366)	18/01/24	(1,369,520)
USD	18,228,596	COP	(76,131,516,958)	18/01/24	(1,360,128)
USD	23,142,249	CNY	(167,324,135)	18/01/24	(494,585)
EUR	17,520,000	PLN	(77,745,850)	18/01/24	(401,715)
USD	17,140,000	CLP	(15,326,715,536)	18/01/24	(397,138)
EUR	14,480,000	CHF	(13,751,723)	18/01/24	(360,376)
USD	10,440,627	GBP	(8,460,722)	18/01/24	(346,048)
EUR	7,880,000	HUF	(3,116,083,398)	17/01/24	(277,514)
EUR	7,620,000	HUF	(2,985,619,357)	18/01/24	(186,930)
EUR	7,740,000	SEK	(88,021,915)	18/01/24	(184,453)
GBP	10,660,007	EUR	(12,390,000)	18/01/24	(104,563)
EUR	23,911,840	GBP	(20,802,523)	18/01/24	(90,727)
USD	9,216,371	IDR	(142,600,306,793)	18/01/24	(33,419)
USD	800,000	CAD	(1,095,668)	18/01/24	(31,122)
USD	430,000	NZD	(712,419)	18/01/24	(21,096)
USD	328,589	THB	(11,752,258)	18/01/24	(16,196)
USD	141,679	PLN	(618,919)	18/01/24	(15,684)
USD	410,000	KRW	(551,630,400)	18/01/24	(15,659)
CNY	39,603,234	USD	(5,610,000)	18/01/24	(15,499)
HUF	3,022,935,000	EUR	(7,900,000)	18/01/24	(14,958)
GBP	4,495,767	USD	(5,740,000)	18/01/24	(8,294)
USD	31,473	AUD	(49,630)	18/01/24	(2,409)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(23,960,176)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
NOK	3,168,197,325	USD	(291,172,873)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	20,829,818
NOK	1,480,432,320	EUR	(125,858,643)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	6,735,988
JPY	17,871,847,455	USD	(121,920,775)	Q - JPY (BHedged)	09/01/24	4,967,861
NOK	618,746,022	CNH	(406,892,581)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	3,769,600
NOK	718,243,478	JPY	(9,628,916,081)	I - NOK (BHedged)	09/01/24	2,369,615
NOK	269,087,708	GBP	(19,612,397)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	1,497,093
JPY	8,358,293,643	EUR	(52,744,184)	Q - JPY (BHedged)	09/01/24	1,065,932
JPY	3,490,210,436	CNH	(170,480,152)	Q - JPY (BHedged)	09/01/24	827,715
NOK	179,116,606	CAD	(22,282,820)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	739,133
EUR	26,672,822	USD	(28,793,480)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	676,290
NOK	91,554,217	AUD	(12,762,352)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	306,418
JPY	1,515,944,120	GBP	(8,218,676)	Q - JPY (BHedged)	09/01/24	285,565
EUR	28,492,440	USD	(31,287,467)	Q - EUR	08/01/24	192,727
NOK	36,466,979	CHF	(2,919,318)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	120,880
EUR	5,210,741	CNH	(40,261,101)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	100,873
NOK	22,024,908	MXN	(35,226,040)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	90,480
JPY	1,015,378,455	CAD	(9,396,682)	Q - JPY (BHedged)	09/01/24	82,166
NOK	24,796,628	SEK	(23,816,825)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	78,206
NOK	14,070,608	SGD	(1,731,141)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	72,995
NOK	10,654,086	CZK	(22,089,129)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	61,014
NOK	13,325,153	PLN	(4,922,487)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	60,498
NOK	7,979,293	USD	(729,543)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	56,255
NOK	12,005,169	DKK	(7,607,384)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	54,692
NOK	10,668,333	NZD	(1,590,579)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	43,522
NOK	7,391,110	ILS	(2,510,056)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	30,778
EUR	2,264,154	GBP	(1,940,572)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	27,667
NOK	6,000,647	RON	(2,537,666)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	27,498
NOK	4,570,864	HUF	(148,347,281)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	21,701
EUR	5,569,924	CNH	(43,651,514)	Q - EUR	08/01/24	21,402
NOK	3,724,232	EUR	(315,628)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	18,035
JPY	79,349,013	SGD	(725,475)	Q - JPY (BHedged)	09/01/24	13,239
JPY	516,024,972	AUD	(5,350,177)	Q - JPY (BHedged)	09/01/24	12,329
JPY	59,953,073	CZK	(9,251,886)	Q - JPY (BHedged)	09/01/24	11,773
EUR	451,970	USD	(487,890)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	11,474
JPY	123,981,202	MXN	(14,739,543)	Q - JPY (BHedged)	09/01/24	10,681
NOK	1,558,099	CNH	(1,020,121)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	10,125
JPY	75,001,772	PLN	(2,063,501)	Q - JPY (BHedged)	09/01/24	7,777
JPY	67,642,320	DKK	(3,187,942)	Q - JPY (BHedged)	09/01/24	7,712
NOK	1,837,695	JPY	(24,627,856)	M - NOK (BHedged)	09/01/24	6,124
EUR	239,518	USD	(258,720)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	5,914
JPY	208,262,331	CHF	(1,239,586)	Q - JPY (BHedged)	09/01/24	4,919
JPY	60,475,790	NZD	(670,616)	Q - JPY (BHedged)	09/01/24	4,762
NOK	671,369	HKD	(481,887)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	4,399
NOK	677,456	GBP	(49,180)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	4,019
JPY	33,777,989	RON	(1,063,219)	Q - JPY (BHedged)	09/01/24	3,755
JPY	41,953,507	ILS	(1,059,878)	Q - JPY (BHedged)	09/01/24	3,512
JPY	26,086,147	HUF	(63,091,911)	Q - JPY (BHedged)	09/01/24	3,025
NOK	453,763	CAD	(56,232)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	2,038
EUR	88,300	CNH	(682,205)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	1,717
EUR	89,546	CZK	(2,185,220)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	1,177
JPY	3,783,975	HKD	(201,784)	Q - JPY (BHedged)	09/01/24	1,022
EUR	118,239	SGD	(170,943)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	1,016
NOK	230,391	AUD	(32,018)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	838
EUR	46,812	CNH	(362,399)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	807
EUR	96,564	CZK	(2,370,130)	Q - EUR	08/01/24	657

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
JPY	139,836,332	SEK	(9,997,474)	Q - JPY (BHedged)	09/01/24	567
				M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	471
EUR	38,373	GBP	(32,888)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	340
NOK	93,346	CHF	(7,447)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	254
NOK	55,414	MXN	(88,204)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	249
USD	28,460	NOK	(286,472)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	209
NOK	62,416	SEK	(59,833)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	197
NOK	35,429	SGD	(4,341)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	170
EUR	20,367	GBP	(17,518)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	162
NOK	26,796	CZK	(55,362)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	161
NOK	33,517	PLN	(12,348)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	147
NOK	30,201	DKK	(19,077)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	141
EUR	5,652	HKD	(47,654)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	120
NOK	27,026	NZD	(4,013)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	108
JPY	920,994	NOK	(65,292)	M - NOK (BHedged)	09/01/24	104
EUR	223,608	SEK	(2,488,246)	Q - EUR	08/01/24	85
NOK	18,748	ILS	(6,343)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	74
NOK	15,095	RON	(6,362)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	63
CNH	39,706	NOK	(56,008)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	58
NOK	11,658	HUF	(377,540)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	55
JPY	996,830	EUR	(6,356)	I - EUR (BHedged)	09/01/24	42
EUR	12,045	NOK	(134,710)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	41
				M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	09/01/24	37
JPY	936,304	EUR	(5,979)	Q - EUR	08/01/24	31
EUR	6,035	HKD	(51,770)	I - EUR (BHedged)	09/01/24	20
EUR	13,937	JPY	(2,164,484)	Q - EUR	08/01/24	20
EUR	54,391	RON	(270,568)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	20
EUR	1,517	CZK	(37,021)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	18
EUR	38,470	HUF	(14,710,217)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	16
EUR	2,008	SGD	(2,903)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	15
CAD	2,141	NOK	(16,323)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	14
USD	2,696	EUR	(2,426)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	13
GBP	1,895	NOK	(24,393)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	13
AUD	1,514	EUR	(925)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	12
				M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	11
AUD	1,251	EUR	(761)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	10
CAD	2,193	EUR	(1,495)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	8
NOK	1,691	HKD	(1,207)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	7
CAD	2,660	EUR	(1,815)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	7
EUR	1,065	SGD	(1,541)	Q - EUR	08/01/24	6
EUR	808	CZK	(19,780)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	5
CHF	350	EUR	(371)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	4
EUR	5,302	PLN	(23,013)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	4
				Q - EUR	08/01/24	4
CHF	288	EUR	(306)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	4
CNH	3,761	EUR	(474)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	4
AUD	1,206	NOK	(8,313)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	4
NOK	627	EUR	(54)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	4
MXN	4,216	EUR	(223)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	4
CHF	280	NOK	(3,340)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	4

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
SEK	2,104	EUR	(187)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	3
NOK	478	EUR	(40)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	3
EUR	534	PLN	(2,311)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	2
EUR	51	HKD	(428)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	2
EUR	96	HKD	(807)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	2
EUR	215	SEK	(2,372)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	2
JPY	116,385	NOK	(8,369)	Q - JPY (BHedged)	09/01/24	2
SEK	2,803	EUR	(250)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	2
GBP	179	EUR	(207)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	1
EUR	110	JPY	(16,994)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	09/01/24	1
NZD	152	NOK	(971)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	1
NZD	157	EUR	(89)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	1
EUR	20	USD	(21)	I - USD (BHedged)	08/01/24	1
SGD	167	NOK	(1,275)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	1
EUR	269	GBP	(233)	Q - EUR	08/01/24	1
EUR	460	PLN	(1,995)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	1
JPY	9,860	EUR	(63)	Q - EUR	09/01/24	1
ILS	245	EUR	(61)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	1
MXN	3,375	NOK	(2,003)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	1
ILS	297	EUR	(74)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	1
EUR	1	NZD	(1)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	0
AUD	13	EUR	(8)	Q - EUR	08/01/24	0
HUF	25	USD	–	I - USD (BHedged)	08/01/24	0
EUR	–	ILS	(1)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	0
MXN	6	USD	–	I - USD (BHedged)	08/01/24	0
EUR	1	MXN	(21)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	0
NOK	1	USD	–	I - USD (BHedged)	08/01/24	0
PLN	1	USD	–	I - USD (BHedged)	08/01/24	0
EUR	–	RON	(2)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	0
CAD	23	EUR	(16)	Q - EUR	08/01/24	0
EUR	166	HUF	(63,522)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	0
JPY	1,505	USD	(10)	I - USD (BHedged)	09/01/24	0
USD	13	HKD	(102)	I - USD (BHedged)	08/01/24	0
CZK	23	EUR	(1)	Q - EUR	08/01/24	0
HKD	1	EUR	–	Q - EUR	08/01/24	0
MXN	36	EUR	(2)	Q - EUR	08/01/24	0
SEK	3	EUR	–	Q - EUR	08/01/24	0
PLN	5	EUR	(1)	Q - EUR	08/01/24	0
RON	3	EUR	(1)	Q - EUR	08/01/24	0
GBP	21	EUR	(24)	Q - EUR	08/01/24	0
HUF	157	EUR	–	Q - EUR	08/01/24	0
EUR	5	HUF	(1,791)	Q - EUR	08/01/24	0
EUR	–	JPY	(34)	Q - EUR	09/01/24	0
NOK	5	EUR	–	Q - EUR	08/01/24	0
ILS	3	EUR	(1)	Q - EUR	08/01/24	0
NZD	2	EUR	(1)	Q - EUR	08/01/24	0
USD	39	EUR	(35)	Q - EUR	08/01/24	0
AUD	2	USD	(1)	I - USD (BHedged)	08/01/24	0
CAD	4	USD	(3)	I - USD (BHedged)	08/01/24	0
EUR	160	DKK	(1,192)	Q - EUR	08/01/24	0

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
CHF	–	USD	(1)	I - USD (BHedged)	08/01/24	0
DKK	8	EUR	(1)	Q - EUR	08/01/24	0
CNH	64	USD	(9)	I - USD (BHedged)	08/01/24	0
CZK	3	USD	–	I - USD (BHedged)	08/01/24	0
DKK	1	USD	–	I - USD (BHedged)	08/01/24	0
CNH	54	EUR	(7)	Q - EUR	08/01/24	0
EUR	452	CHF	(420)	Q - EUR	08/01/24	0
GBP	3	USD	(4)	I - USD (BHedged)	08/01/24	0
CHF	3	EUR	(3)	Q - EUR	08/01/24	0
SGD	2	EUR	(1)	Q - EUR	08/01/24	0
PLN	2	EUR	(1)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
RON	1	NOK	(2)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	0
EUR	3	DKK	(23)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	0
DKK	746	EUR	(100)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	0
CZK	205	EUR	(8)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	0
RON	36	EUR	(7)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
EUR	41	RON	(205)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
HUF	11,823	EUR	(31)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
EUR	22	NOK	(246)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
EUR	3	ILS	(14)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
NZD	190	EUR	(108)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
EUR	–	NZD	–	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
RON	243	NOK	(547)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	0
EUR	203	DKK	(1,515)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
DKK	424	EUR	(57)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
SEK	8	NOK	(8)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	0
CZK	9	EUR	–	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
CNH	13	EUR	(2)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
ILS	240	NOK	(668)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	0
EUR	96	CHF	(90)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
HUF	14,569	NOK	(425)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	0
HKD	47	NOK	(61)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	0
EUR	1	CAD	(1)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
DKK	729	NOK	(1,093)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	0
CZK	2,147	NOK	(971)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	0
EUR	1	AUD	(1)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
PLN	471	NOK	(1,214)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	0
EUR	–	MXN	(5)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
EUR	660	HUF	(252,444)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	0
HUF	14,938	EUR	(39)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	0
SGD	1	NOK	(5)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	0
SEK	1	NOK	(1)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	0
USD	5	NOK	(52)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	0
MXN	1	NOK	(1)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	0
JPY	164	NOK	(12)	I - NOK (BHedged)	09/01/24	0
ILS	1	NOK	(3)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	0
HUF	59	NOK	(2)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	0
GBP	–	NOK	(6)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	0
EUR	2	NOK	(24)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	0
DKK	3	NOK	(5)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	0
CZK	1	NOK	–	I - NOK (BHedged)	08/01/24	0

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
CNH	7	NOK	(10)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	0
CHF	1	NOK	(14)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	0
CAD	–	NOK	(3)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	0
AUD	–	NOK	(1)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	0
SGD	1	EUR	(1)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
SGD	16	EUR	(11)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	0
GBP	3	EUR	(3)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
PLN	438	EUR	(101)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	0
EUR	3	PLN	(15)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	0
MXN	3,445	EUR	(183)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	0
SEK	4	USD	–	I - USD (BHedged)	08/01/24	0
EUR	2	MXN	(44)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	0
HKD	4	EUR	(1)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	0
RON	249	EUR	(50)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	0
EUR	2	RON	(8)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	0
EUR	480	DKK	(3,579)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						45,371,379
USD	6,353,108	EUR	(5,885,544)	I - USD (BHedged)	08/01/24	(149,602)
USD	3,132,849	JPY	(459,283,435)	I - USD (BHedged)	09/01/24	(128,025)
EUR	6,123,648	JPY	(970,318,862)	I - EUR (BHedged)	09/01/24	(123,141)
EUR	6,502,771	JPY	(1,022,820,696)	Q - EUR	09/01/24	(77,005)
USD	773,581	CAD	(1,048,580)	I - USD (BHedged)	08/01/24	(21,705)
USD	1,154,266	GBP	(917,083)	I - USD (BHedged)	08/01/24	(14,863)
USD	393,078	AUD	(597,051)	I - USD (BHedged)	08/01/24	(14,386)
USD	2,658,541	CNH	(19,023,092)	I - USD (BHedged)	08/01/24	(14,009)
EUR	771,331	AUD	(1,264,620)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	(10,838)
EUR	1,625,693	CAD	(2,378,307)	Q - EUR	08/01/24	(7,640)
JPY	29,687,887	NOK	(2,215,267)	Q - JPY (BHedged)	09/01/24	(7,383)
EUR	1,517,987	CAD	(2,221,029)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	(7,351)
USD	291,144	EUR	(269,712)	C - USD (BHedged)	08/01/24	(6,851)
NOK	10,667,792	JPY	(148,840,105)	I - NOK (BHedged)	09/01/24	(6,165)
USD	143,580	JPY	(21,049,778)	C - USD (BHedged)	09/01/24	(5,871)
USD	159,240	CHF	(138,878)	I - USD (BHedged)	08/01/24	(5,853)
EUR	331,939	CHF	(313,391)	Q - EUR	08/01/24	(5,802)
EUR	312,278	CHF	(294,041)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	(4,523)
USD	146,043	NOK	(1,528,221)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(4,455)
USD	106,489	SEK	(1,115,809)	I - USD (BHedged)	08/01/24	(4,252)
EUR	208,693	SEK	(2,360,691)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	(3,715)
USD	94,477	MXN	(1,644,816)	I - USD (BHedged)	08/01/24	(2,576)
EUR	44,528	NOK	(525,379)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	(2,543)
EUR	103,827	JPY	(16,454,460)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	09/01/24	(2,106)
USD	22,688	NOK	(248,150)	I - USD (BHedged)	08/01/24	(1,749)
EUR	2,429,205	GBP	(2,106,641)	Q - EUR	08/01/24	(1,684)
USD	18,700	NOK	(205,246)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	(1,513)
USD	57,143	PLN	(230,259)	I - USD (BHedged)	08/01/24	(1,410)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
EUR	827,955	AUD	(1,342,373)	Q - EUR	08/01/24	(1,341)
EUR	62,848	NOK	(718,630)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(1,332)
USD	46,073	NZD	(74,839)	I - USD (BHedged)	08/01/24	(1,312)
USD	51,527	DKK	(355,733)	I - USD (BHedged)	08/01/24	(1,200)
USD	35,452	CAD	(48,054)	C - USD (BHedged)	08/01/24	(995)
JPY	4,697,498	NOK	(348,309)	I - NOK (BHedged)	09/01/24	(950)
USD	60,451	SGD	(80,955)	I - USD (BHedged)	08/01/24	(935)
USD	31,920	ILS	(118,289)	I - USD (BHedged)	08/01/24	(932)
CNH	203,075	NOK	(298,782)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(894)
EUR	199,434	MXN	(3,749,114)	Q - EUR	08/01/24	(870)
EUR	185,346	MXN	(3,483,873)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	(783)
USD	52,897	GBP	(42,027)	C - USD (BHedged)	08/01/24	(681)
USD	18,014	AUD	(27,361)	C - USD (BHedged)	08/01/24	(659)
EUR	54,823	JPY	(8,624,282)	M - EUR (BHedged)	09/01/24	(658)
USD	121,836	CNH	(871,780)	C - USD (BHedged)	08/01/24	(640)
				M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	(609)
USD	25,695	EUR	(23,808)			
USD	25,737	RON	(118,640)	I - USD (BHedged)	08/01/24	(604)
USD	34,596	EUR	(31,858)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	(602)
NOK	587,966	CHF	(49,163)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(542)
USD	45,677	CZK	(1,032,350)	I - USD (BHedged)	08/01/24	(507)
EUR	8,150	NOK	(96,515)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	(500)
EUR	90,395	NZD	(158,516)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	(492)
USD	19,876	HUF	(7,039,751)	I - USD (BHedged)	08/01/24	(455)
NOK	1,008,678	USD	(99,756)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(422)
EUR	48,348	NOK	(545,937)	Q - EUR	08/01/24	(346)
GBP	9,781	NOK	(130,128)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(345)
EUR	42,300	HUF	(16,299,766)	Q - EUR	08/01/24	(340)
EUR	62,702	ILS	(250,508)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	(293)
USD	7,298	CHF	(6,365)	C - USD (BHedged)	08/01/24	(268)
EUR	115,568	PLN	(503,149)	Q - EUR	08/01/24	(261)
CNH	26,283	NOK	(40,127)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	(259)
EUR	38,769	USD	(43,071)	Q - EUR	08/01/24	(237)
EUR	126,913	SGD	(185,229)	Q - EUR	08/01/24	(232)
JPY	618,419	NOK	(46,779)	M - NOK (BHedged)	09/01/24	(216)
USD	4,880	SEK	(51,135)	C - USD (BHedged)	08/01/24	(195)
				M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	(183)
EUR	13,060	AUD	(21,411)			
NOK	1,154,574	CAD	(150,148)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(176)
EUR	111,647	PLN	(485,717)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	(160)
CAD	11,114	NOK	(87,077)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(146)
EUR	96,695	NZD	(168,936)	Q - EUR	08/01/24	(130)
				M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	(123)
EUR	25,703	CAD	(37,604)			
EUR	19,728	USD	(21,919)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	(122)
USD	4,330	MXN	(75,375)	C - USD (BHedged)	08/01/24	(118)
GBP	1,268	NOK	(17,477)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	(104)
EUR	66,478	ILS	(264,832)	Q - EUR	08/01/24	(102)
EUR	6,937	AUD	(11,376)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	(99)
NOK	197,206	CNH	(138,951)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(99)
CNH	48,305	EUR	(6,227)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	(94)
EUR	13,635	CAD	(19,975)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	(86)
USD	1,040	NOK	(11,371)	C - USD (BHedged)	08/01/24	(80)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
EUR	5,290	CHF	(4,980)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	(77)
AUD	6,295	NOK	(44,349)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(71)
CNH	36,106	EUR	(4,655)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	(71)
USD	2,619	PLN	(10,552)	C - USD (BHedged)	08/01/24	(65)
EUR	3,537	SEK	(40,014)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	(63)
NOK	193,113	EUR	(17,267)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(60)
USD	2,111	NZD	(3,430)	C - USD (BHedged)	08/01/24	(60)
USD	2,361	DKK	(16,302)	C - USD (BHedged)	08/01/24	(55)
CAD	1,450	NOK	(11,695)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	(52)
EUR	2,796	CHF	(2,637)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	(44)
JPY	800,146	CHF	(4,815)	Q - JPY (BHedged)	09/01/24	(44)
USD	1,463	ILS	(5,421)	C - USD (BHedged)	08/01/24	(43)
USD	2,770	SGD	(3,710)	C - USD (BHedged)	08/01/24	(43)
EUR	754	NOK	(8,898)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	(43)
EUR	8,197	CNH	(64,737)	Q - EUR	08/01/24	(39)
EUR	1,876	SEK	(21,178)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	(30)
EUR	4,139	CNH	(32,756)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	(28)
USD	1,179	RON	(5,437)	C - USD (BHedged)	08/01/24	(28)
EUR	108,623	DKK	(809,869)	Q - EUR	08/01/24	(27)
NOK	47,213	ILS	(16,823)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(23)
USD	2,093	CZK	(47,308)	C - USD (BHedged)	08/01/24	(23)
AUD	827	NOK	(5,956)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	(22)
NOK	85,890	GBP	(6,652)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(22)
EUR	403	NOK	(4,754)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	(22)
GBP	1,741	EUR	(2,027)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	(21)
USD	911	HUF	(322,586)	C - USD (BHedged)	08/01/24	(21)
GBP	2,332	EUR	(2,709)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	(21)
SEK	11,720	NOK	(11,977)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(16)
SGD	863	NOK	(6,793)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(15)
PLN	2,448	NOK	(6,474)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(15)
CZK	11,106	NOK	(5,179)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(14)
MXN	17,590	NOK	(10,682)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(14)
EUR	50,449	RON	(251,092)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	(13)
EUR	1,668	MXN	(31,453)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	(13)
EUR	3,136	MXN	(58,940)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	(13)
DKK	3,792	NOK	(5,822)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(11)
NOK	68,513	HUF	(2,339,425)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(10)
SEK	3,736	NOK	(3,845)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	(9)
CHF	190	NOK	(2,388)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	(9)
EUR	1,531	NZD	(2,684)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	(8)
EUR	811	NZD	(1,427)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	(8)
MXN	2,274	NOK	(1,434)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	(7)
NZD	795	NOK	(5,179)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(7)
EUR	100,873	DKK	(751,962)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	(6)
NOK	11,921	AUD	(1,729)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(6)
RON	1,265	NOK	(2,911)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(6)
SGD	112	NOK	(912)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	(5)
CHF	1,469	NOK	(17,790)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(5)
EUR	2,206	GBP	(1,916)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	(5)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
JPY	140,141	EUR	(905)	I - EUR (BHedged)	09/01/24	(5)
				M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	(5)
EUR	1,062	ILS	(4,242)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(5)
ILS	1,244	NOK	(3,558)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	(4)
DKK	492	NOK	(782)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	(4)
PLN	319	NOK	(869)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	(4)
EUR	560	ILS	(2,238)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(4)
HUF	75,946	NOK	(2,264)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	(4)
CZK	1,442	NOK	(695)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	(4)
NZD	103	NOK	(695)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	(3)
EUR	1,895	PLN	(8,242)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	(3)
ILS	162	NOK	(478)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(3)
NOK	66,647	NZD	(10,370)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(3)
NOK	2,871	MXN	(4,837)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(3)
NOK	4,487	SGD	(585)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(2)
CZK	2,632	EUR	(108)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	(2)
RON	164	NOK	(391)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	(2)
EUR	527	HUF	(202,456)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	(2)
USD	2,870	HKD	(22,413)	I - USD (BHedged)	08/01/24	(1)
HUF	9,865	NOK	(304)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	(1)
EUR	361	SGD	(527)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	(1)
USD	267	EUR	(243)	Q - EUR	08/01/24	(1)
				M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	(1)
SGD	153	EUR	(106)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	(1)
EUR	455	RON	(2,264)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	(1)
				I - NOK (BHedged)	08/01/24	(1)
CZK	1,980	EUR	(81)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	(1)
HKD	241	NOK	(323)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	0
NOK	783	RON	(349)	C - USD (BHedged)	08/01/24	0
				I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
PLN	44	EUR	(10)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	0
USD	132	HKD	(1,032)	Q - EUR	08/01/24	0
SGD	205	EUR	(141)	M - NOK (BHedged)	08/01/24	0
				I - NOK (BHedged)	08/01/24	0
EUR	1,708	DKK	(12,734)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	0
EUR	131	CZK	(3,250)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
HKD	31	NOK	(43)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
NOK	214	HKD	(165)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
NOK	1,740	PLN	(675)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
CAD	0	EUR	0	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
EUR	4	HKD	(36)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	0
EUR	430	DKK	(3,205)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	0
				I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
NOK	46	EUR	(4)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
PLN	583	EUR	(134)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
RON	266	EUR	(53)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
EUR	187	HUF	(71,390)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	0
EUR	67	CZK	(1,651)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
				M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	0
HKD	43	EUR	(5)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
DKK	482	EUR	(65)	Q - EUR	08/01/24	0
EUR	8	HKD	(71)	Q - EUR	08/01/24	0
SEK	21	EUR	(2)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
MXN	1	EUR	0	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	0
				I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
EUR	853	RON	(4,247)	M - EUR (BHedged)	08/01/24	0
EUR	477	PLN	(2,075)			0

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
NOK	1,566	DKK	(1,044)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	0
HUF	6,274	EUR	(16)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
CNH	372	EUR	(47)	Q - EUR	08/01/24	0
HKD	57	EUR	(7)	I - EUR (BHedged)	08/01/24	0
NOK	1,392	CZK	(3,076)	I - NOK (BHedged)	08/01/24	0
SEK	209	EUR	(19)	M - EUR (BHedged)- (AIDiv)	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(662,145)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
EUR	1,931,018	USD	(2,036,192)	18/01/24	98,234
EUR	46,011	USD	(50,822)	08/01/24	14
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					98,248
USD	42,245,666	EUR	(39,424,736)	18/01/24	(1,331,975)
GBP	464,912	USD	(592,832)	08/01/24	(147)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(1,332,122)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
JPY	17,092,573,869	USD	(116,715,213)	S - JPY	09/01/24	4,640,646
CAD	102,423,086	USD	(75,588,571)	Y - CAD	08/01/24	2,093,245
GBP	81,831,307	USD	(103,018,171)	K - GBP (MIDiv)	08/01/24	1,303,141
AUD	36,959,299	USD	(24,347,923)	I - AUD	08/01/24	875,342
GBP	26,652,728	USD	(33,556,406)	K - GBP	08/01/24	421,391
EUR	15,442,269	USD	(16,674,932)	M - EUR	08/01/24	386,634
EUR	2,531,431	USD	(2,733,516)	Q - EUR (AIDiv)	08/01/24	63,365
EUR	1,716,813	USD	(1,853,867)	S - EUR	08/01/24	42,974
USD	1	EUR	(1)	M - EUR	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						9,826,738

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
USD	2,128,569	GBP	(1,686,055)	K - GBP (MIDiv)	08/01/24	(20,871)
USD	492,906	EUR	(456,618)	M - EUR	08/01/24	(11,594)
EUR	3,342	USD	(3,712)	M - EUR	08/01/24	(20)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(32,485)

BlueBay Funds – BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
CLP	46,707,634,795	USD	(50,681,318)	18/01/24	2,762,504
CAD	85,732,535	USD	(62,529,981)	18/01/24	2,502,664
JPY	8,345,969,708	USD	(57,055,882)	18/01/24	2,286,564
PLN	199,966,938	EUR	(44,736,844)	18/01/24	1,393,167
ZAR	789,976,662	USD	(42,024,932)	18/01/24	1,115,098
IDR	749,904,560,737	USD	(47,708,345)	18/01/24	934,330
TWD	779,974,686	USD	(24,734,475)	18/01/24	884,464
COP	108,202,686,610	USD	(27,169,736)	18/01/24	670,934
MXN	326,830,000	USD	(18,844,654)	18/01/24	404,827
EUR	16,466,404	USD	(17,900,003)	18/01/24	300,931
CHF	12,826,785	EUR	(13,605,010)	18/01/24	226,784
HUF	11,316,688,619	EUR	(29,348,193)	18/01/24	194,167
GBP	9,855,053	USD	(12,494,447)	18/01/24	69,876
EUR	2,018,296	GBP	(1,743,577)	18/01/24	7,991
EUR	1,843,717	HUF	(704,467,101)	18/01/24	6,465
EUR	2,213	USD	(2,445)	08/01/24	1
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					13,760,767

USD	188,965,685	MXN	(3,341,994,849)	18/01/24	(7,869,578)
USD	155,464,174	EUR	(146,273,737)	18/01/24	(6,217,681)
USD	100,903,819	ZAR	(1,897,443,130)	18/01/24	(2,714,122)
USD	49,780,246	COP	(203,345,861,080)	18/01/24	(2,540,868)
USD	51,968,583	CLP	(46,665,369,520)	18/01/24	(1,426,877)
EUR	34,177,869	HUF	(13,449,959,117)	18/01/24	(1,007,437)
EUR	34,570,000	CHF	(32,879,423)	18/01/24	(917,654)
EUR	23,240,000	HUF	(9,190,073,373)	17/01/24	(818,455)
USD	24,773,808	CAD	(33,609,535)	18/01/24	(720,794)
USD	25,490,891	JPY	(3,662,110,500)	18/01/24	(547,855)
EUR	47,010,000	PLN	(205,809,953)	18/01/24	(366,175)
USD	7,859,990	GBP	(6,388,692)	18/01/24	(285,028)
GBP	27,436,851	EUR	(31,880,523)	18/01/24	(259,175)
EUR	59,262,523	GBP	(51,582,860)	18/01/24	(258,503)
USD	48,630,000	IDR	(752,105,552,629)	18/01/24	(155,444)
USD	1,617,089	TWD	(50,358,407)	18/01/24	(36,976)
USD	54,524	CZK	(1,270,636)	18/01/24	(2,300)

Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt

(26,144,922)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
SEK	1,095,515,942	USD	(104,557,705)	Q - SEK (CPerf)	08/01/24	4,169,130
SEK	1,035,376,255	USD	(98,724,398)	Q - SEK (CPerf)	04/01/24	4,017,482
EUR	106,659,720	USD	(115,166,252)	I - EUR	08/01/24	2,677,943
EUR	101,343,359	USD	(109,388,535)	I - EUR	04/01/24	2,564,749
USD	104,425,886	SEK	(1,035,376,255)	Q - SEK (CPerf)	04/01/24	1,684,007
EUR	41,461,507	USD	(44,755,464)	I - EUR (Perf)	08/01/24	1,053,750
EUR	41,429,221	USD	(44,720,732)	Q - EUR (CPerf)	08/01/24	1,052,811
EUR	39,364,115	USD	(42,477,641)	I - EUR (Perf)	04/01/24	1,007,615
EUR	38,648,098	USD	(41,698,078)	Q - EUR (CPerf)	04/01/24	996,199
USD	112,593,820	EUR	(101,343,359)	I - EUR	04/01/24	640,536
CAD	56,930,758	USD	(42,549,263)	I - CAD (ACDiv)	08/01/24	629,330
CAD	27,987,811	USD	(20,642,578)	I - CAD (ACDiv)	04/01/24	583,158
EUR	20,707,150	USD	(22,353,198)	M - EUR (CPerf)	08/01/24	525,329
EUR	18,991,931	USD	(20,501,837)	M - EUR	08/01/24	481,612
EUR	16,408,735	USD	(17,685,822)	M - EUR (CPerf)	04/01/24	440,790
EUR	13,089,571	USD	(14,026,361)	M - EUR	04/01/24	433,595
NOK	58,625,792	USD	(5,360,446)	Q - NOK (CPerf)	08/01/24	412,996
NOK	55,392,956	USD	(5,059,956)	Q - NOK (CPerf)	04/01/24	394,555
EUR	15,062,065	USD	(16,258,795)	ZR - EUR (CPerf)	08/01/24	382,697
EUR	14,483,726	USD	(15,630,024)	ZR - EUR (CPerf)	04/01/24	370,044
JPY	1,999,283,443	USD	(13,859,232)	I - JPY (Perf)	09/01/24	335,514
JPY	984,946,727	USD	(6,715,040)	I - JPY (Perf)	04/01/24	272,490
EUR	10,308,090	USD	(11,127,044)	I - EUR (CPerf)	08/01/24	261,965
USD	43,734,055	EUR	(39,364,115)	I - EUR (Perf)	04/01/24	248,799
USD	42,938,551	EUR	(38,648,098)	Q - EUR (CPerf)	04/01/24	244,274
EUR	9,247,950	USD	(9,977,471)	I - EUR (CPerf)	04/01/24	238,673
EUR	7,073,705	USD	(7,636,098)	C - EUR (CPerf)	08/01/24	179,365
EUR	6,742,810	USD	(7,276,510)	C - EUR (CPerf)	04/01/24	172,224
GBP	6,885,846	USD	(8,666,499)	ZR - GBP (CPerf)- (AIDiv)	08/01/24	111,810
GBP	6,554,835	USD	(8,248,542)	ZR - GBP (CPerf)- (AIDiv)	04/01/24	107,601
USD	18,230,323	EUR	(16,408,735)	M - EUR (CPerf)	04/01/24	103,711
GBP	5,770,656	USD	(7,262,939)	I - GBP (Perf)	08/01/24	93,689
USD	16,091,612	EUR	(14,483,726)	ZR - EUR (CPerf)	04/01/24	91,544
GBP	5,565,714	USD	(7,004,111)	I - GBP (Perf)	04/01/24	91,095
USD	14,542,688	EUR	(13,089,571)	M - EUR	04/01/24	82,732
USD	10,274,595	EUR	(9,247,950)	I - EUR (CPerf)	04/01/24	58,451
GBP	3,059,535	USD	(3,850,725)	C - GBP (CPerf)	08/01/24	49,673
GBP	2,932,952	USD	(3,690,970)	C - GBP (CPerf)	04/01/24	47,976
USD	5,501,095	NOK	(55,392,956)	Q - NOK (CPerf)	04/01/24	46,583
USD	7,491,352	EUR	(6,742,810)	C - EUR (CPerf)	04/01/24	42,618
USD	8,382,742	GBP	(6,554,835)	ZR - GBP (CPerf)- (AIDiv)	04/01/24	26,598
USD	7,117,790	GBP	(5,565,714)	I - GBP (Perf)	04/01/24	22,584
USD	3,750,847	GBP	(2,932,952)	C - GBP (CPerf)	04/01/24	11,901
USD	895,647	SEK	(8,929,530)	Q - SEK (CPerf)	08/01/24	9,417
EUR	220,597	USD	(238,123)	C - EUR (CPerf)- (QIDiv)	08/01/24	5,607
EUR	210,188	USD	(226,810)	C - EUR (CPerf)- (QIDiv)	04/01/24	5,383
USD	702,750	EUR	(632,559)	I - EUR	08/01/24	3,860
USD	274,771	EUR	(247,327)	I - EUR (Perf)	08/01/24	1,509
USD	233,521	EUR	(210,188)	C - EUR (CPerf)- (QIDiv)	04/01/24	1,328
USD	151,567	EUR	(136,427)	M - EUR (CPerf)	08/01/24	835
USD	97,772	EUR	(88,006)	ZR - EUR (CPerf)	08/01/24	537
USD	91,226	EUR	(82,114)	M - EUR	08/01/24	501

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
USD	67,109	EUR	(60,406)	I - EUR (CPerf)	08/01/24	369
USD	47,521	EUR	(42,774)	C - EUR (CPerf)	08/01/24	261
				ZR - GBP (CPerf)- (AIDiv)	08/01/24	192
USD	120,592	GBP	(94,443)	I - GBP (Perf)	08/01/24	142
USD	88,182	GBP	(69,061)	C - GBP (CPerf)	08/01/24	81
USD	50,115	GBP	(39,247)	Q - NOK (CPerf)	08/01/24	38
USD	34,549	NOK	(350,434)	Q - EUR (CPerf)	08/01/24	36
USD	6,481	EUR	(5,833)	I - JPY (Perf)	09/01/24	14
USD	43,903	JPY	(6,181,671)	C - EUR (CPerf)- (QIDiv)	08/01/24	8
USD	1,469	EUR	(1,322)			
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						27,490,316
USD	104,338,857	SEK	(1,093,321,169)	Q - SEK (CPerf)	08/01/24	(4,170,154)
USD	115,166,252	EUR	(106,659,720)	I - EUR	08/01/24	(2,677,943)
SEK	1,035,698,955	USD	(104,458,399)	Q - SEK (CPerf)	08/01/24	(1,668,228)
USD	44,755,464	EUR	(41,461,507)	I - EUR (Perf)	08/01/24	(1,053,750)
USD	44,715,703	EUR	(41,424,694)	Q - EUR (CPerf)	08/01/24	(1,052,838)
EUR	101,343,359	USD	(112,593,820)	I - EUR	08/01/24	(623,466)
USD	21,485,192	CAD	(29,118,453)	I - CAD (ACDiv)	08/01/24	(599,423)
USD	22,316,779	EUR	(20,674,371)	M - EUR (CPerf)	08/01/24	(525,532)
USD	20,501,837	EUR	(18,991,931)	M - EUR	08/01/24	(481,611)
USD	5,360,446	NOK	(58,625,792)	Q - NOK (CPerf)	08/01/24	(412,996)
USD	16,258,795	EUR	(15,062,065)	ZR - EUR (CPerf)	08/01/24	(382,697)
USD	6,920,344	JPY	(1,014,336,718)	I - JPY (Perf)	09/01/24	(281,364)
USD	11,124,509	EUR	(10,305,808)	I - EUR (CPerf)	08/01/24	(261,981)
EUR	39,364,115	USD	(43,734,055)	I - EUR (Perf)	08/01/24	(242,169)
EUR	38,648,115	USD	(42,938,569)	Q - EUR (CPerf)	08/01/24	(237,764)
USD	7,635,684	EUR	(7,073,332)	C - EUR (CPerf)	08/01/24	(179,367)
				ZR - GBP (CPerf)- (AIDiv)	08/01/24	(111,896)
USD	8,599,490	GBP	(6,833,351)	M - EUR (CPerf)	08/01/24	(100,948)
EUR	16,408,857	USD	(18,230,459)	I - GBP (Perf)	08/01/24	(93,758)
USD	7,212,956	GBP	(5,731,503)	ZR - EUR (CPerf)	08/01/24	(89,104)
EUR	14,483,726	USD	(16,091,612)	M - EUR	08/01/24	(80,527)
EUR	13,089,571	USD	(14,542,688)	I - EUR (CPerf)	08/01/24	(56,894)
EUR	9,247,958	USD	(10,274,604)	C - GBP (CPerf)	08/01/24	(49,709)
USD	3,824,293	GBP	(3,038,829)	I - JPY (Perf)	04/01/24	(48,641)
USD	6,938,889	JPY	(984,946,727)	Q - NOK (CPerf)	08/01/24	(46,021)
NOK	55,392,956	USD	(5,501,095)	C - EUR (CPerf)	08/01/24	(41,482)
EUR	6,742,811	USD	(7,491,353)	I - CAD (ACDiv)	04/01/24	(28,563)
USD	21,197,173	CAD	(27,987,811)	ZR - GBP (CPerf)- (AIDiv)	08/01/24	(26,425)
GBP	6,556,772	USD	(8,385,219)	I - GBP (Perf)	08/01/24	(22,431)
GBP	5,565,714	USD	(7,117,790)	C - GBP (CPerf)	08/01/24	(11,820)
GBP	2,932,952	USD	(3,750,847)	C - EUR (CPerf)- (QIDiv)	08/01/24	(5,607)
USD	238,123	EUR	(220,597)	C - EUR (CPerf)- (QIDiv)	08/01/24	(1,293)
EUR	210,188	USD	(233,521)			
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(15,666,402)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
EUR	950,000	USD	(1,015,507)	18/01/24	34,564
GBP	470,000	USD	(574,293)	18/01/24	24,915
USD	1,149,561	GBP	(900,000)	18/01/24	2,140
EUR	32,292	USD	(35,668)	08/01/24	10
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					61,629
USD	99,604,839	EUR	(93,604,004)	18/01/24	(3,859,182)
USD	22,385,683	GBP	(18,264,558)	18/01/24	(900,017)
USD	816,657	CAD	(1,120,000)	18/01/24	(32,921)
EUR	3,100,000	USD	(3,431,295)	18/01/24	(4,748)
GBP	772,843	USD	(985,491)	08/01/24	(244)
USD	185,582	GBP	(145,575)	08/01/24	(2)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(4,797,114)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
NOK	5,686,812,952	USD	(531,951,727)	I - NOK	08/01/24	28,083,133
NOK	2,809,097,998	USD	(268,734,747)	I - NOK	04/01/24	7,875,479
USD	278,972,559	NOK	(2,809,097,998)	I - NOK	04/01/24	2,362,333
EUR	100,378,927	USD	(109,411,917)	S - EUR	08/01/24	1,492,874
GBP	41,483,774	USD	(52,191,173)	S-GBP (QIDiv)	08/01/24	693,742
EUR	21,564,408	USD	(23,504,605)	I - EUR	08/01/24	321,075
USD	56,370,624	EUR	(50,738,028)	S - EUR	04/01/24	320,687
EUR	50,738,028	USD	(55,834,837)	S - EUR	04/01/24	215,100
USD	52,136,538	GBP	(40,767,855)	S-GBP (QIDiv)	04/01/24	165,427
GBP	5,938,779	USD	(7,475,830)	S - GBP	08/01/24	95,126
EUR	5,791,068	USD	(6,312,103)	K - EUR (AIDiv)	08/01/24	86,223
USD	12,087,228	EUR	(10,879,463)	I - EUR	04/01/24	68,763
USD	52,028,925	GBP	(40,767,855)	S-GBP (QIDiv)	08/01/24	56,687
EUR	3,651,929	USD	(3,980,509)	S - EUR (QIDiv)	08/01/24	54,364
EUR	3,325,843	USD	(3,625,064)	R - EUR	08/01/24	49,531
EUR	10,879,463	USD	(11,972,428)	I - EUR	04/01/24	46,037
GBP	2,071,914	USD	(2,608,149)	C - GBP (AIDiv)	08/01/24	33,197
USD	7,364,464	GBP	(5,758,599)	S - GBP	04/01/24	23,367
USD	3,246,190	EUR	(2,921,828)	K - EUR (AIDiv)	04/01/24	18,467
EUR	1,213,283	USD	(1,322,463)	C - EUR	08/01/24	18,046
EUR	2,921,828	USD	(3,215,360)	K - EUR (AIDiv)	04/01/24	12,363
USD	2,047,652	EUR	(1,843,049)	S - EUR (QIDiv)	04/01/24	11,649
USD	1,847,302	EUR	(1,662,719)	R - EUR	04/01/24	10,509
USD	7,360,037	GBP	(5,766,631)	S - GBP	08/01/24	8,541
USD	2,643,104	GBP	(2,066,760)	C - GBP (AIDiv)	04/01/24	8,386
EUR	1,843,049	USD	(2,028,205)	S - EUR (QIDiv)	04/01/24	7,798
EUR	1,662,719	USD	(1,829,802)	R - EUR	04/01/24	6,991
EUR	390,487	USD	(425,478)	Q - EUR	08/01/24	5,958
USD	2,637,624	GBP	(2,066,761)	C - GBP (AIDiv)	08/01/24	2,848
USD	430,334	EUR	(387,334)	C - EUR	04/01/24	2,448
EUR	387,334	USD	(426,394)	C - EUR	04/01/24	1,491
USD	211,281	EUR	(190,170)	Q - EUR	04/01/24	1,202

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
GBP	50,574	USD	(63,670)	C - GBP	08/01/24	805
EUR	190,170	USD	(209,274)	Q - EUR	04/01/24	805
USD	58,590	GBP	(45,814)	C - GBP	04/01/24	186
USD	58,520	GBP	(45,814)	C - GBP	08/01/24	115
USD	88	EUR	(79)	S - EUR	08/01/24	0
USD	72	EUR	(65)	C - EUR	08/01/24	0

Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt

42,161,753

USD	533,386,407	NOK	(5,701,253,912)	I - NOK	08/01/24	(28,070,594)
NOK	2,823,538,958	USD	(280,407,239)	I - NOK	08/01/24	(2,346,353)
USD	109,724,006	EUR	(100,659,808)	S - EUR	08/01/24	(1,491,117)
USD	51,704,833	GBP	(41,100,255)	S-GBP (QIDiv)	08/01/24	(691,159)
USD	23,567,493	EUR	(21,621,007)	I - EUR	08/01/24	(320,721)
EUR	51,053,094	USD	(56,720,686)	S - EUR	08/01/24	(314,099)
GBP	84,352,191	USD	(107,765,715)	S-GBP (QIDiv)	08/01/24	(230,695)
USD	7,847,742	GBP	(6,230,233)	S - GBP	08/01/24	(94,768)
USD	6,329,167	EUR	(5,806,425)	K - EUR (AIDiv)	08/01/24	(86,128)
EUR	10,936,062	USD	(12,150,116)	I - EUR	08/01/24	(67,285)
GBP	40,767,855	USD	(52,028,987)	S-GBP (QIDiv)	04/01/24	(57,876)
USD	3,991,277	EUR	(3,661,620)	S - EUR (QIDiv)	08/01/24	(54,305)
USD	3,634,443	EUR	(3,334,284)	R - EUR	08/01/24	(49,478)
USD	2,566,812	GBP	(2,039,381)	C - GBP (AIDiv)	08/01/24	(33,060)
GBP	11,808,671	USD	(15,086,180)	S - GBP	08/01/24	(32,087)
EUR	2,937,185	USD	(3,263,253)	K - EUR (AIDiv)	08/01/24	(18,071)
USD	1,322,390	EUR	(1,213,218)	C - EUR	08/01/24	(18,047)
EUR	1,852,740	USD	(2,058,420)	S - EUR (QIDiv)	08/01/24	(11,399)
GBP	4,101,092	USD	(5,239,525)	C - GBP (AIDiv)	08/01/24	(11,315)
EUR	1,671,159	USD	(1,856,681)	R - EUR	08/01/24	(10,282)
GBP	5,758,599	USD	(7,349,788)	S - GBP	04/01/24	(8,691)
USD	426,582	EUR	(391,481)	Q - EUR	08/01/24	(5,951)
GBP	2,066,760	USD	(2,637,626)	C - GBP (AIDiv)	04/01/24	(2,908)
EUR	387,334	USD	(430,334)	C - EUR	08/01/24	(2,383)
EUR	191,164	USD	(212,386)	Q - EUR	08/01/24	(1,176)
USD	69,099	GBP	(54,865)	C - GBP	08/01/24	(845)
GBP	95,920	USD	(122,539)	C - GBP	08/01/24	(258)
GBP	45,814	USD	(58,520)	C - GBP	04/01/24	(116)

Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt

(34,031,167)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Structured Credit Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) EUR
EUR	33,942,739	USD	(36,113,954)	18/01/24	1,270,422
EUR	14,414,358	GBP	(12,389,265)	18/01/24	124,416

Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt

1,394,838

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Structured Credit Fund (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) EUR
EUR	45,513,836	GBP	(39,493,693)	18/01/24	(38,710)
GBP	3,800,000	EUR	(4,400,476)	18/01/24	(17,506)
GBP	2,247	EUR	(2,594)	08/01/24	(1)
USD	952	EUR	(862)	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(56,217)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) EUR
EUR	493,861	USD	(533,662)	S - USD	08/01/24	10,848
EUR	360,195	USD	(389,199)	Q - USD	08/01/24	7,935
EUR	335,693	USD	(362,724)	I - USD	08/01/24	7,395
USD	304,374	EUR	(273,972)	Q - USD	08/01/24	1,513
EUR	101,285	GBP	(87,002)	G - GBP	08/01/24	899
EUR	77,691	GBP	(66,961)	S - GBP	08/01/24	428
EUR	1,416	USD	(1,530)	G - USD	08/01/24	31
GBP	2,287	EUR	(2,628)	G - GBP	08/01/24	10
EUR	408	USD	(441)	G - USD (QIDiv)	08/01/24	9
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					29,068	

USD	50,765,131	EUR	(47,029,122)	Q - USD	08/01/24	(1,082,047)
USD	49,979,954	EUR	(46,297,937)	I - USD	08/01/24	(1,061,519)
USD	35,825,783	EUR	(33,184,699)	S - USD	08/01/24	(759,096)
GBP	2,194,658	EUR	(2,560,574)	S - GBP	08/01/24	(28,288)
GBP	1,149,366	EUR	(1,340,974)	Q - GBP	08/01/24	(14,790)
GBP	508,974	EUR	(593,835)	G - GBP	08/01/24	(6,560)
USD	200,122	EUR	(185,373)	G - USD	08/01/24	(4,245)
GBP	139,152	EUR	(162,350)	G - GBP (QIDiv)	08/01/24	(1,790)
USD	57,613	EUR	(53,369)	G - USD (QIDiv)	08/01/24	(1,223)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(2,959,558)	

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
EUR	22,799	USD	(24,041)	18/01/24	1,160
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					1,160

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
USD	4,697,951	EUR	(4,386,373)	18/01/24	(150,472)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(150,472)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
EUR	25,098,964	USD	(27,098,313)	K - EUR	08/01/24	632,560
JPY	1,361,094,414	USD	(9,286,847)	S - JPY	09/01/24	376,810
EUR	10,725,351	USD	(11,578,371)	M - EUR	08/01/24	271,655
GBP	5,294,642	USD	(6,664,452)	G - GBP (AIDiv)	08/01/24	85,336
EUR	252,221	USD	(272,286)	G - EUR	08/01/24	6,383
EUR	129,424	USD	(139,711)	R - EUR	08/01/24	3,286
GBP	1,201	USD	(1,512)	G - GBP	08/01/24	19
USD	6	EUR	(5)	K - EUR	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					1,376,049	
USD	177,658	EUR	(164,585)	M - EUR	08/01/24	(4,186)
EUR	179,969	USD	(199,942)	K - EUR	08/01/24	(1,102)
USD	142,435	EUR	(129,424)	R - EUR	08/01/24	(561)
USD	12,241	EUR	(11,114)	K - EUR	08/01/24	(37)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(5,886)	

BlueBay Funds – BlueBay High Grade Structured Credit Short Duration Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) EUR
EUR	2,706,275	USD	(2,870,000)	18/01/24	109,784
GBP	4,500,000	EUR	(5,141,393)	18/01/24	48,967
EUR	439,187	GBP	(377,013)	18/01/24	4,336
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					163,087
EUR	32,495,043	GBP	(28,199,407)	18/01/24	(30,525)
USD	3,000,000	EUR	(2,729,269)	18/01/24	(15,167)
GBP	250,000	EUR	(289,689)	18/01/24	(1,335)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(47,027)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay High Grade Structured Credit Short Duration Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) EUR
EUR	37,590	USD	(40,617)	K - USD	08/01/24	828
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						828
USD	14,064,036	EUR	(13,028,782)	K - USD	08/01/24	(299,546)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(299,546)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade ESG Bond Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) EUR
EUR	2,529,476	USD	(2,685,195)	18/01/24	100,178
GBP	230,000	EUR	(264,168)	18/01/24	1,117
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					101,295
USD	200,000	EUR	(184,900)	18/01/24	(3,960)
EUR	1,954,567	GBP	(1,696,530)	18/01/24	(2,233)
GBP	160,000	EUR	(186,755)	18/01/24	(2,209)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(8,402)

BlueBay Funds – BlueBay Impact – Aligned Bond Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
EUR	4,600,000	USD	(4,861,431)	18/01/24	223,122
GBP	1,850,000	USD	(2,264,227)	18/01/24	94,359
USD	984,395	EUR	(890,000)	18/01/24	645
EUR	2,253	USD	(2,489)	08/01/24	1
USD	184	GBP	(145)	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					318,127
USD	69,205,081	EUR	(64,965,341)	18/01/24	(2,603,550)
USD	25,584,194	GBP	(20,936,923)	18/01/24	(1,108,537)
GBP	73,807	USD	(94,115)	08/01/24	(23)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(3,712,110)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Impact-Aligned Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
GBP	46,005,812	USD	(57,912,835)	G - GBP	08/01/24	736,927
GBP	27,217,080	USD	(34,260,991)	K - GBP	08/01/24	436,262
GBP	9,862,064	USD	(12,414,395)	C - GBP	08/01/24	158,097
CHF	2,613,422	USD	(2,997,766)	K - CHF	08/01/24	108,973
GBP	6,279,721	USD	(7,906,305)	G - GBP (QIDiv)	08/01/24	99,295
EUR	1,148,442	USD	(1,240,193)	K - EUR	08/01/24	28,675
GBP	526,303	USD	(662,513)	X - GBP	08/01/24	8,436
EUR	256,112	USD	(276,574)	G - EUR	08/01/24	6,394
EUR	192,564	USD	(207,948)	G - EUR (QIDiv)	08/01/24	4,809
CHF	13,019	USD	(14,933)	R - CHF	08/01/24	545
GBP	10,322	USD	(12,994)	C - GBP (QIDiv)	08/01/24	165
GBP	9,608	USD	(12,094)	S - GBP	08/01/24	154
GBP	9,608	USD	(12,094)	S - GBP (QIDiv)	08/01/24	154
USD	85,571	GBP	(67,009)	C - GBP	08/01/24	144
USD	361	GBP	(283)	G - GBP	08/01/24	1
USD	1	GBP	(1)	G - GBP (QIDiv)	08/01/24	0

Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt

1,589,031

USD	512,971	GBP	(407,257)	G - GBP	08/01/24	(6,214)
USD	405,701	GBP	(321,460)	C - GBP	08/01/24	(4,104)
USD	267,113	GBP	(212,115)	K - GBP	08/01/24	(3,298)
GBP	1,075,768	USD	(1,373,673)	G - GBP	08/01/24	(2,249)
GBP	400,026	USD	(510,773)	K - GBP	08/01/24	(807)
USD	63,510	GBP	(50,431)	G - GBP (QIDiv)	08/01/24	(780)
USD	21,337	EUR	(19,747)	K - EUR	08/01/24	(481)
GBP	141,824	USD	(181,088)	C - GBP	08/01/24	(285)
GBP	96,595	USD	(123,349)	G - GBP (QIDiv)	08/01/24	(206)
CHF	14,811	USD	(17,723)	K - CHF	08/01/24	(117)
USD	5,014	EUR	(4,640)	G - EUR	08/01/24	(113)
USD	3,770	EUR	(3,489)	G - EUR (QIDiv)	08/01/24	(85)
USD	5,165	GBP	(4,101)	X - GBP	08/01/24	(64)
EUR	6,481	USD	(7,200)	K - EUR	08/01/24	(40)
EUR	5,163	USD	(5,736)	G - EUR (QIDiv)	08/01/24	(32)
GBP	7,788	USD	(9,944)	X - GBP	08/01/24	(15)
EUR	1,442	USD	(1,602)	G - EUR	08/01/24	(9)
USD	29	CHF	(25)	K - CHF	08/01/24	(1)
CHF	73	USD	(87)	R - CHF	08/01/24	(1)
USD	101	GBP	(80)	C - GBP (QIDiv)	08/01/24	(1)
GBP	151	USD	(193)	C - GBP (QIDiv)	08/01/24	0
USD	27	GBP	(22)	S - GBP	08/01/24	0
GBP	142	USD	(181)	S - GBP	08/01/24	0
GBP	142	USD	(181)	S - GBP (QIDiv)	08/01/24	0
USD	27	GBP	(22)	S - GBP (QIDiv)	08/01/24	0

Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt

(18,902)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Government Bond Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
JPY	4,154,601,257	USD	(28,759,115)	18/01/24	781,394
COP	18,809,984,716	USD	(4,430,000)	18/01/24	409,829
MXN	104,399,390	USD	(5,874,079)	18/01/24	274,789
CLP	4,694,735,900	USD	(5,116,848)	18/01/24	254,965
PLN	19,794,656	EUR	(4,350,000)	18/01/24	224,660
EUR	7,146,455	USD	(7,713,219)	18/01/24	186,026
ILS	9,878,134	USD	(2,569,902)	18/01/24	174,070
CAD	5,618,054	USD	(4,100,000)	18/01/24	161,590
SEK	21,616,801	EUR	(1,852,098)	18/01/24	99,156
CNY	22,468,818	USD	(3,090,000)	18/01/24	84,029
NOK	23,258,694	EUR	(2,002,102)	18/01/24	78,136
TWD	66,190,754	USD	(2,100,000)	18/01/24	74,092
ZAR	70,322,410	USD	(3,775,073)	18/01/24	65,180
IDR	32,075,532,000	USD	(2,040,000)	18/01/24	40,585
CHF	961,617	EUR	(1,020,000)	18/01/24	16,958
GBP	1,658,544	EUR	(1,900,000)	18/01/24	14,356
AUD	278,964	USD	(184,504)	18/01/24	5,946
EUR	1,000,000	GBP	(862,402)	18/01/24	5,851
HUF	323,926,680	EUR	(840,000)	18/01/24	5,621
GBP	90,000	USD	(109,821)	18/01/24	4,921
USD	29	GBP	(23)	08/01/24	0

Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt

2,962,154

USD	56,667,090	JPY	(8,309,055,791)	18/01/24	(2,412,886)
USD	61,087,623	EUR	(57,437,672)	18/01/24	(2,400,393)
USD	25,677,333	MXN	(458,314,223)	18/01/24	(1,316,246)
USD	6,229,062	COP	(26,275,957,167)	18/01/24	(531,772)
USD	9,162,619	ZAR	(175,818,276)	18/01/24	(438,684)
USD	9,636,900	GBP	(7,871,409)	18/01/24	(398,453)
USD	3,040,000	ILS	(12,055,667)	18/01/24	(308,853)
USD	4,640,891	CAD	(6,353,262)	18/01/24	(178,393)
USD	5,340,000	CLP	(4,815,626,082)	18/01/24	(170,137)
USD	1,494,386	THB	(54,893,733)	18/01/24	(116,073)
USD	1,196,479	PLN	(5,125,000)	18/01/24	(106,575)
EUR	4,300,000	PLN	(19,078,795)	18/01/24	(97,917)
USD	3,085,017	CNY	(22,471,482)	18/01/24	(89,389)
EUR	3,043,508	CHF	(2,894,248)	18/01/24	(80,286)
EUR	1,940,000	HUF	(767,182,333)	17/01/24	(68,393)
EUR	1,973,782	HUF	(773,600,420)	18/01/24	(49,129)
EUR	1,770,000	SEK	(20,136,385)	18/01/24	(42,910)
USD	4,197,546	IDR	(65,242,287,669)	18/01/24	(34,404)
EUR	5,721,101	GBP	(4,976,654)	18/01/24	(21,047)
GBP	2,263,694	EUR	(2,630,000)	18/01/24	(21,028)
USD	176,908	AUD	(278,964)	18/01/24	(13,542)
USD	398,564	NZD	(641,402)	18/01/24	(7,565)
HUF	738,514,500	EUR	(1,930,000)	18/01/24	(3,654)
EUR	225,000	USD	(250,579)	18/01/24	(1,878)
GBP	23	USD	(29)	08/01/24	0

Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt

(8,909,607)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Government Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
EUR	94,743,619	USD	(102,291,652)	I - EUR	08/01/24	2,386,905
GBP	98,064,871	USD	(123,445,364)	S - GBP (AIDiv)	08/01/24	1,571,045
EUR	592,219	USD	(642,894)	S - EUR	08/01/24	11,425
EUR	217,098	USD	(235,348)	S - EUR (AIDiv)	08/01/24	4,515
GBP	77,968	USD	(97,750)	S - GBP	08/01/24	1,647
USD	64,119	EUR	(57,715)	I - EUR	08/01/24	352
CHF	10,478	USD	(12,264)	S - CHF	08/01/24	192
GBP	9,839	USD	(12,385)	Q - GBP	08/01/24	158
GBP	9,573	USD	(12,050)	Q - GBP (QIDiv)	08/01/24	153
USD	6,252	GBP	(4,889)	S - GBP (AIDiv)	08/01/24	18
USD	1	EUR	(1)	S - EUR (AIDiv)	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						3,976,410
USD	1,898,444	EUR	(1,756,481)	I - EUR	08/01/24	(42,223)
USD	1,547,637	GBP	(1,226,770)	S - GBP (AIDiv)	08/01/24	(16,291)
EUR	690,435	USD	(767,048)	I - EUR	08/01/24	(4,213)
GBP	1,393,437	USD	(1,779,349)	S - GBP (AIDiv)	08/01/24	(2,949)
EUR	169,341	USD	(188,141)	S - EUR	08/01/24	(1,042)
USD	3,334	EUR	(3,086)	S - EUR	08/01/24	(75)
USD	3,257	EUR	(3,008)	S - EUR (AIDiv)	08/01/24	(67)
EUR	1,531	USD	(1,701)	S - EUR (AIDiv)	08/01/24	(9)
GBP	589	USD	(752)	S - GBP	08/01/24	(1)
USD	95	GBP	(75)	S - GBP	08/01/24	(1)
USD	98	GBP	(78)	Q - GBP	08/01/24	(1)
USD	48	CHF	(41)	S - CHF	08/01/24	(1)
GBP	137	USD	(175)	Q - GBP	08/01/24	0
GBP	72	USD	(92)	Q - GBP (QIDiv)	08/01/24	0
USD	27	GBP	(22)	Q - GBP (QIDiv)	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(66,873)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Financials Plus Bond Fund

Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
EUR	4,088,429	USD	(4,413,588)	18/01/24	105,506
GBP	3,395,271	USD	(4,250,295)	18/01/24	78,376
USD	233,990	GBP	(183,372)	18/01/24	206
USD	50	GBP	(39)	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt					184,088
USD	19,082,905	GBP	(15,688,956)	18/01/24	(919,131)
USD	18,262,848	EUR	(17,202,784)	18/01/24	(752,036)
GBP	705	USD	(899)	08/01/24	0
USD	849	GBP	(666)	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt					(1,671,167)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

a) Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Financials Plus Bond Fund (Fortsetzung)

Abgesicherte Aktienklasse Devisenterminkontrakte

Währung Kauf	Betrag Währung Kauf	Währung Verkauf	Betrag Währung Verkauf	Aktienklasse	Fälligkeits- datum	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
GBP	10,064	USD	(12,669)	C - GBP (QCDiv)	08/01/24	161
GBP	9,623	USD	(12,113)	S - GBP	08/01/24	154
GBP	9,623	USD	(12,113)	S - GBP (QIDiv)	08/01/24	154
GBP	8,201	USD	(10,324)	C - GBP	08/01/24	131
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						600
USD	99	GBP	(78)	C - GBP (QCDiv)	08/01/24	(1)
USD	80	GBP	(64)	C - GBP	08/01/24	(1)
GBP	73	USD	(93)	C - GBP (QCDiv)	08/01/24	0
GBP	59	USD	(76)	C - GBP	08/01/24	0
GBP	70	USD	(89)	S - GBP	08/01/24	0
USD	27	GBP	(22)	S - GBP	08/01/24	0
GBP	70	USD	(89)	S - GBP (QIDiv)	08/01/24	0
USD	27	GBP	(22)	S - GBP (QIDiv)	08/01/24	0
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(2)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

b) Finanzterminkontrakte

Zum 31. Dezember 2023 bestanden bei der SICAV die folgenden offenen Finanzterminkontrakte:

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund

Anzahl der Kontrakte	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
226	US 2YR Note (CBT) March Futures 24	28/03/24	USD	446,703
119	US 5YR Note (CBT) March Futures 24	28/03/24	USD	277,047
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt				723,750
(56)	US Ultra Bond (CBT) March Futures 24	19/03/24	USD	(637,000)
(60)	US 10YR Ultra March Futures 24	19/03/24	USD	(297,649)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt				(934,649)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund

Anzahl der Kontrakte	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) EUR
1,815	Euro-Bobl March Futures 24	07/03/24	EUR	3,190,440
4,781	Euro-Schatz March Futures 24	07/03/24	EUR	2,940,345
14	US Long Bond (CBT) March Futures 24	19/03/24	USD	62,180
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt				6,192,965
(2,230)	Euro-Bund March Futures 24	07/03/24	EUR	(7,460,642)
(464)	US Ultra Bond (CBT) March Futures 24	19/03/24	USD	(4,680,182)
(575)	US 10YR Ultra March Futures 24	19/03/24	USD	(2,732,766)
(310)	Long Gilt March Futures 24	26/03/24	GBP	(2,033,501)
(328)	US 5YR Note (CBT) March Futures 24	28/03/24	USD	(623,063)
(151)	US 10YR Note (CBT) March Futures 24	19/03/24	USD	(105,166)
(17)	Euro-Buxl 30Y Bond March Futures 24	07/03/24	EUR	(82,555)
(43)	US 2YR Note (CBT) March Futures 24	28/03/24	USD	(40,447)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt				(17,758,322)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund

Anzahl der Kontrakte	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
(1)	JPN 10Y Bond (Ose) March Futures 24	13/03/24	JPY	(11,178)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt				(11,178)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

b) Finanzterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Select Bond Fund

Anzahl der Kontrakte	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
(29)	US 10YR Ultra March Futures 24	19/03/24	USD	(143,864)
(7)	US Ultra Bond (CBT) March Futures 24	19/03/24	USD	(79,625)
(2)	JPN 10Y Bond (Ose) March Futures 24	13/03/24	JPY	(22,356)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt				(245,845)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund

Anzahl der Kontrakte	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
117	US 2YR Note (CBT) March Futures 24	28/03/24	USD	231,258
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt				231,258
(56)	US 10YR Ultra March Futures 24	19/03/24	USD	(277,806)
(42)	US 5YR Note (CBT) March Futures 24	28/03/24	USD	(98,110)
(20)	Euro-Bobl March Futures 24	07/03/24	EUR	(50,370)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt				(426,286)

BlueBay Funds – BlueBay Global Convertible Bond Fund

Anzahl der Kontrakte	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
(4)	S&P 500 Emini March Futures 24	15/03/24	USD	(5,750)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt				(5,750)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund

Anzahl der Kontrakte	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) EUR
1,352	Euro-Btp March Futures 24	07/03/24	EUR	5,800,048
1,682	Euro-Bobl March Futures 24	07/03/24	EUR	3,420,967
530	Euro-Oat March Futures 24	07/03/24	EUR	2,474,656
412	US 10YR Ultra March Futures 24	19/03/24	USD	1,961,002
577	US 10YR Note (CBT) March Futures 24	19/03/24	USD	1,928,433
2,699	Euro-Schatz March Futures 24	07/03/24	EUR	1,804,637
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt				17,389,743

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

b) Finanzterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund (Fortsetzung)

Anzahl der Kontrakte	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) EUR
(1,933)	Long Gilt March Futures 24	26/03/24	GBP	(13,372,619)
(724)	JPN 10Y Bond (Ose) March Futures 24	13/03/24	JPY	(6,299,382)
(1,468)	Euro-Bund March Futures 24	07/03/24	EUR	(5,294,967)
(249)	Euro-Buxl 30Y Bond March Futures 24	07/03/24	EUR	(2,531,569)
(3,614)	3M Euribor September Futures 24	16/09/24	EUR	(1,704,923)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt				(29,203,460)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund

Anzahl der Kontrakte	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) EUR
756	Euro-Oat March Futures 24	07/03/24	EUR	3,529,887
4,016	Euro-Schatz March Futures 24	07/03/24	EUR	2,804,545
843	Euro-Bobl March Futures 24	07/03/24	EUR	1,508,387
255	US 10YR Ultra March Futures 24	19/03/24	USD	1,213,727
363	US 10YR Note (CBT) March Futures 24	19/03/24	USD	1,213,208
66	US 5YR Note (CBT) March Futures 24	28/03/24	USD	98,957
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt				10,368,711
(2,220)	Euro-Bund March Futures 24	07/03/24	EUR	(9,339,320)
(1,320)	Long Gilt March Futures 24	26/03/24	GBP	(9,131,683)
(473)	Euro-Buxl 30Y Bond March Futures 24	07/03/24	EUR	(5,047,031)
(444)	JPN 10Y Bond (Ose) March Futures 24	13/03/24	JPY	(3,863,122)
(2,307)	3M Euribor September Futures 24	16/09/24	EUR	(1,088,359)
(232)	Euro-Btp March Futures 24	07/03/24	EUR	(962,800)
(225)	Short Euro-Btp March Futures 24	07/03/24	EUR	(220,500)
(3)	US 2YR Note (CBT) March Futures 24	28/03/24	USD	(6,259)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt				(29,659,074)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund

Anzahl der Kontrakte	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
57	US 2YR Note (CBT) March Futures 24	28/03/24	USD	112,664
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt				112,664
(24)	US 10YR Ultra March Futures 24	19/03/24	USD	(119,060)
(25)	US 5YR Note (CBT) March Futures 24	28/03/24	USD	(58,398)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt				(177,458)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

b) Finanzterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund

Anzahl der Kontrakte	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) EUR
13	US Ultra Bond (CBT) March Futures 24	19/03/24	USD	113,931
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt				113,931
(1,491)	Euro-Bund March Futures 24	07/03/24	EUR	(6,431,847)
(799)	Long Gilt March Futures 24	26/03/24	GBP	(5,525,637)
(327)	US Long Bond (CBT) March Futures 24	19/03/24	USD	(2,973,829)
(1,233)	Euro-Bobl March Futures 24	07/03/24	EUR	(2,766,051)
(236)	Euro-Buxl 30Y Bond March Futures 24	07/03/24	EUR	(2,588,914)
(190)	JPN 10Y Bond (Ose) March Futures 24	13/03/24	JPY	(1,576,724)
(1,325)	3M Euribor September Futures 24	16/09/24	EUR	(625,076)
(700)	Euro-Schatz March Futures 24	07/03/24	EUR	(458,500)
(89)	US 5YR Note (CBT) March Futures 24	28/03/24	USD	(196,387)
(194)	US 10YR Ultra March Futures 24	19/03/24	USD	(139,948)
(1)	US 10YR Note (CBT) March Futures 24	19/03/24	USD	(2,445)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt				(23,285,358)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund

Anzahl der Kontrakte	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
25	US 2YR Note (CBT) March Futures	28/03/24	USD	49,414
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt				49,414

BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund

Anzahl der Kontrakte	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
1,501	US 2YR Note (CBT) March Futures 24	28/03/24	USD	2,565,801
387	Long Gilt March Futures 24	26/03/24	GBP	2,506,257
638	US Long Bond (CBT) March Futures 24	19/03/24	USD	2,174,858
465	Canadian 10YR Bond March Futures 24	19/03/24	CAD	1,890,186
350	US Ultra Bond (CBT) March Futures 24	19/03/24	USD	1,365,783
770	US 5YR Note (CBT) March Futures 24	28/03/24	USD	827,593
1,224	Euro-Schatz March Futures 24	07/03/24	EUR	734,276
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt				12,064,754

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

b) Finanzterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund (Fortsetzung)

Anzahl der Kontrakte	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
(1,583)	US 10YR Ultra March Futures 24	19/03/24	USD	(5,921,033)
(732)	Euro-Bund March Futures 24	07/03/24	EUR	(2,502,389)
(566)	US 10YR Note (CBT) March Futures 24	19/03/24	USD	(818,156)
(58)	JPN 10Y Bond (Ose) March Futures 24	13/03/24	JPY	(557,445)
(38)	Euro-Buxl 30Y Bond March Futures 24	07/03/24	EUR	(319,939)
(243)	Euro-Bobl March Futures 24	07/03/24	EUR	(243,549)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt				(10,362,511)

BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund

Anzahl der Kontrakte	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
659	US 2YR Note (CBT) March Futures 24	28/03/24	USD	1,496,210
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt				1,496,210
(74)	JPN 10Y Bond (Ose) March Futures 24	13/03/24	JPY	(701,834)
(67)	Euro-Bund March Futures 24	07/03/24	EUR	(320,232)
(90)	Euro-Bobl March Futures 24	07/03/24	EUR	(198,837)
(27)	US 10YR Ultra March Futures 24	19/03/24	USD	(133,942)
(12)	S&P 500 Emini March Futures 24	15/03/24	USD	(17,250)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt				(1,372,095)

BlueBay Funds – BlueBay Financial Capital Bond Fund

Anzahl der Kontrakte	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
(179)	JPN 10Y Bond (Ose) March Futures 24	13/03/24	JPY	(1,720,429)
(75)	US 5YR Note (CBT) March Futures 24	28/03/24	USD	(182,814)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt				(1,903,243)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

b) Finanzterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund

Anzahl der Kontrakte	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
596	US 10YR Note (CBT) March Futures 24	19/03/24	USD	1,037,651
147	Euro-Oat March Futures 24	07/03/24	EUR	671,209
278	Canadian 10YR Bond March Futures 24	19/03/24	CAD	617,200
122	Euro-Btp March Futures 24	07/03/24	EUR	509,904
194	US 2YR Note (CBT) March Futures 24	28/03/24	USD	371,594
38	US Ultra Bond (CBT) March Futures 24	19/03/24	USD	242,437
264	Euro-Schatz March Futures 24	07/03/24	EUR	184,724
15	US Long Bond (CBT) March Futures 24	19/03/24	USD	70,219
2	US 5YR Note (CBT) March Futures 24	28/03/24	USD	4,918
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt				3,709,856
(1,574)	Euro-Bund March Futures 24	07/03/24	EUR	(6,659,113)
(475)	Long Gilt March Futures 24	26/03/24	GBP	(3,277,243)
(109)	JPN 10Y Bond (Ose) March Futures 24	13/03/24	JPY	(991,143)
(70)	Euro-Buxl 30Y Bond March Futures 24	07/03/24	EUR	(774,088)
(308)	Euro-Bobl March Futures 24	07/03/24	EUR	(617,516)
(1,064)	3M Euribor September Futures 24	16/09/24	EUR	(510,477)
(64)	US 10YR Ultra March Futures 24	19/03/24	USD	(76,507)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt				(12,906,087)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund

Anzahl der Kontrakte	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
136	US 2YR Note (CBT) March Futures 24	28/03/24	USD	268,813
27	US 5YR Note (CBT) March Futures 24	28/03/24	USD	62,859
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt				331,672

BlueBay Funds – BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund

Anzahl der Kontrakte	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
(882)	Long Gilt March Futures 24	26/03/24	GBP	(6,887,281)
(784)	Euro-Bund March Futures 24	07/03/24	EUR	(3,735,205)
(113)	Euro-Buxl 30Y Bond March Futures 24	07/03/24	EUR	(1,369,332)
(2,226)	3M Euribor September Futures 24	16/09/24	EUR	(1,155,520)
(120)	JPN 10Y Bond (Ose) March Futures 24	13/03/24	JPY	(1,149,531)
(83)	Euro-Bobl March Futures 24	07/03/24	EUR	(209,037)
(254)	US 10YR Note (CBT) March Futures 24	19/03/24	USD	(103,188)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt				(14,609,094)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

b) Finanzterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund

Anzahl der Kontrakte	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
(15)	US 5YR Note (CBT) March Futures 24	28/03/24	USD	(35,039)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt				(35,039)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade ESG Bond Fund

Anzahl der Kontrakte	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) EUR
21	Euro-Bobl March Futures 24	07/03/24	EUR	39,729
34	Euro-Schatz March Futures 24	07/03/24	EUR	22,372
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt				62,101

(20)	Euro-Bund March Futures 24	07/03/24	EUR	(81,900)
(3)	US Ultra Bond (CBT) March Futures 24	19/03/24	USD	(32,759)
(4)	Long Gilt March Futures 24	26/03/24	GBP	(27,570)
(8)	US 5YR Note (CBT) March Futures 24	28/03/24	USD	(17,653)
(3)	US 10YR Ultra March Futures 24	19/03/24	USD	(14,258)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt				(174,140)

BlueBay Funds – BlueBay Impact – Aligned Bond Fund

Anzahl der Kontrakte	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
59	US Ultra Bond (CBT) March Futures 24	19/03/24	USD	562,737
63	US Long Bond (CBT) March Futures 24	19/03/24	USD	527,547
58	US 10YR Note (CBT) March Futures 24	19/03/24	USD	152,031
51	US 5YR Note (CBT) March Futures 24	28/03/24	USD	125,399
21	US 2YR Note (CBT) March Futures 24	28/03/24	USD	48,131
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt				1,415,845

(83)	Long Gilt March Futures 24	26/03/24	GBP	(623,415)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt				(623,415)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

b) Finanzterminkontrakte (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Government Bond Fund

Anzahl der Kontrakte	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
65	US Long Bond (CBT) March Futures 24	19/03/24	USD	653,047
49	US Ultra Bond (CBT) March Futures 24	19/03/24	USD	567,351
82	US 10YR Ultra March Futures 24	19/03/24	USD	424,906
168	US 5YR Note (CBT) March Futures 24	28/03/24	USD	402,112
155	US 10YR Note (CBT) March Futures 24	19/03/24	USD	384,094
65	Euro-Btp March Futures 24	07/03/24	EUR	308,030
47	Euro-Oat March Futures 24	07/03/24	EUR	242,416
50	Euro-Bobl March Futures 24	07/03/24	EUR	105,294
29	US 2YR Note (CBT) March Futures 24	28/03/24	USD	66,467
4	Australia 10YR Bond March Futures 24	15/03/24	AUD	57,371
53	Canadian 10YR Bond March Futures 24	19/03/24	CAD	56,393
29	Euro-Schatz March Futures 24	07/03/24	EUR	21,386
4	Euro-Buxl 30Y Bond March Futures 24	07/03/24	EUR	11,715
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt				3,300,582
(90)	Long Gilt March Futures 24	26/03/24	GBP	(687,372)
(140)	Euro-Bund March Futures 24	07/03/24	EUR	(662,470)
(26)	JPN 10Y Bond (Ose) March Futures 24	13/03/24	JPY	(249,870)
(269)	3M Euribor September Futures 24	16/09/24	EUR	(129,091)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt				(1,728,803)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Financials Plus Bond Fund

Anzahl der Kontrakte	Beschreibung	Fälligkeit	Währung	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
(5)	Long Gilt March Futures 24	26/03/24	GBP	(38,703)
(2)	Euro-Bund March Futures 24	07/03/24	EUR	(9,523)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt				(48,226)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

c) Optionen

Zum 31. Dezember 2023 bestanden bei der SICAV die folgenden offenen Optionskontrakte:

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund

Währung	Anzahl	Beschreibung	Ausübungspreis	Fälligkeit	Kosten USD	Markt- wert USD	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
USD	22	P/O auf CBOE S&P 500	4100.00	15/03/24	59,026	20,680	(38,346)
USD	20	P/O auf CBOE S&P 500	4400.00	19/01/24	58,060	4,400	(53,660)
Insgesamt						25,080	(92,006)
Summe gekaufte Optionen						25,080	(92,006)
Summe verkaufte Optionen						-	-

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund

Währung	Anzahl	Beschreibung	Ausübungspreis	Fälligkeit	Kosten USD	Markt- wert USD	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
USD	43,764	P/O auf USD-ZAR	17.75	25/01/24	5,669	8,337	2,668
USD	1	P/O auf CBOE S&P 500	4100.00	15/03/24	2,683	940	(1,743)
GBP	19,448	P/O auf GBP-USD	1.23	15/01/24	3,201	263	(2,938)
USD	1	P/O auf CBOE S&P 500	4400.00	19/01/24	2,903	220	(2,683)
EUR	25,110	C/O auf EUR-HUF	400.00	04/01/24	3,561	5	(3,556)
Insgesamt						9,765	(8,252)
Summe gekaufte Optionen						9,765	(8,252)
Summe verkaufte Optionen						-	-

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Select Bond Fund

Währung	Anzahl	Beschreibung	Ausübungspreis	Fälligkeit	Kosten USD	Markt- wert USD	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
USD	152,579	P/O auf USD-ZAR	17.75	25/01/24	19,764	29,067	9,303
USD	3	P/O auf CBOE S&P 500	4100.00	15/03/24	8,049	2,820	(5,229)
GBP	67,499	P/O auf GBP-USD	1.23	15/01/24	11,109	912	(10,197)
USD	3	P/O auf CBOE S&P 500	4400.00	19/01/24	8,709	660	(8,049)
EUR	86,466	C/O auf EUR-HUF	400.00	04/01/24	12,263	19	(12,244)
Insgesamt						33,478	(26,416)
Summe gekaufte Optionen						33,478	(26,416)
Summe verkaufte Optionen						-	-

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

c) Optionen (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund

Währung	Anzahl	Beschreibung	Ausübungspreis	Fälligkeit	Kosten USD	Markt- wert USD	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
USD	7	P/O auf CBOE S&P 500	4100.00	15/03/24	18,781	6,580	(12,201)
USD	6	P/O auf CBOE S&P 500	4400.00	19/01/24	17,418	1,320	(16,098)
					Insgesamt	7,900	(28,299)
Summe gekaufte Optionen						7,900	(28,299)
Summe verkaufte Optionen						-	-

BlueBay Funds – BlueBay Global Convertible Bond Fund

Währung	Anzahl	Beschreibung	Ausübungspreis	Fälligkeit	Kosten USD	Markt- wert USD	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
USD	3	C/O auf S&P 500 Index C/O auf Russell 2000	4650.00	15/03/24	28,918	64,920	36,002
USD	2	Index C/O auf	1900.00	15/03/24	9,342	39,330	29,988
EUR	28	STMicroelectronics NV	40.00	21/06/24	8,695	23,723	15,028
JPY	2	C/O auf Nikkei 225	33500.00	08/03/24	13,937	13,406	(531)
EUR	2	SE C/O auf LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton	800.00	21/06/24	6,784	5,972	(812)
EUR	9	AG C/O auf Deutsche Post	43.00	21/06/24	2,801	3,828	1,027
EUR	1	C/O auf L'Oreal SA	440.00	21/06/24	1,936	3,679	1,743
EUR	19	C/O auf Veolia Environnement SA	30.00	21/06/24	4,158	2,183	(1,975)
EUR	25	C/O auf Iberdrola SA	11.50	21/06/24	1,508	2,099	591
					Insgesamt	159,140	81,061
Summe gekaufte Optionen						159,140	81,061
Summe verkaufte Optionen						-	-

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund

Währung	Anzahl	Beschreibung	Ausübungspreis	Fälligkeit	Kosten USD	Markt- wert USD	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
USD	48	P/O auf CBOE S&P 500	4400.00	19/01/24	139,344	10,560	(128,784)
					Insgesamt	10,560	(128,784)
Summe gekaufte Optionen						10,560	(128,784)
Summe verkaufte Optionen						-	-

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

c) Optionen (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund

Währung	Anzahl	Beschreibung	Ausübungspreis	Fälligkeit	Kosten USD	Markt- wert USD	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
USD	4	P/O auf CBOE S&P 500	4100.00	15/03/24	10,732	3,760	(6,972)
USD	4	P/O auf CBOE S&P 500	4400.00	19/01/24	11,612	880	(10,732)
Insgesamt						4,640	(17,704)
Summe gekaufte Optionen						4,640	(17,704)
Summe verkaufte Optionen						-	-

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund

Währung	Anzahl	Beschreibung	Ausübungspreis	Fälligkeit	Kosten USD	Markt- wert USD	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
USD	3	P/O auf CBOE S&P 500	4100.00	15/03/24	8,049	2,820	(5,229)
USD	3	P/O auf CBOE S&P 500	4400.00	19/01/24	8,709	660	(8,049)
Insgesamt						3,480	(13,278)
Summe gekaufte Optionen						3,480	(13,278)
Summe verkaufte Optionen						-	-

BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund

Währung	Anzahl	Beschreibung	Ausübungspreis	Fälligkeit	Kosten USD	Markt- wert USD	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
USD	9	C/O auf S&P 500 Index C/O auf Russell 2000	4650.00	15/03/24	126,066	194,760	68,694
USD	8	Index	1900.00	15/03/24	65,369	157,320	91,951
JPY	6	C/O auf Nikkei 225	33500.00	08/03/24	35,982	40,218	4,236
Insgesamt						392,298	164,881
Summe gekaufte Optionen						392,298	164,881
Summe verkaufte Optionen						-	-

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund

Währung	Anzahl	Beschreibung	Ausübungspreis	Fälligkeit	Kosten USD	Markt- wert USD	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
USD	21	P/O auf CBOE S&P 500	4100.00	15/03/24	56,343	19,740	(36,603)
USD	20	P/O auf CBOE S&P 500	4400.00	19/01/24	58,060	4,400	(53,660)
Insgesamt						24,140	(90,263)
Summe gekaufte Optionen						24,140	(90,263)
Summe verkaufte Optionen						-	-

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

c) Optionen (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund

Währung	Anzahl	Beschreibung	Ausübungspreis	Fälligkeit	Kosten USD	Markt- wert USD	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
USD	938	P/O auf E-Mini S&P 500	4000.00	15/03/24	953,191	340,025	(613,166)
					Insgesamt	340,025	(613,166)
Summe gekaufte Optionen						340,025	(613,166)
Summe verkaufte Optionen						-	-

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund

Währung	Anzahl	Beschreibung	Ausübungspreis	Fälligkeit	Kosten USD	Markt- wert USD	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
USD	2	P/O auf CBOE S&P 500	4100.00	15/03/24	5,365	1,880	(3,485)
USD	2	P/O auf CBOE S&P 500	4400.00	19/01/24	5,805	440	(5,365)
					Insgesamt	2,320	(8,850)
Summe gekaufte Optionen						2,320	(8,850)
Summe verkaufte Optionen						-	-

C/O: Kaufoptionen

P/O: Verkaufsoptionen

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

d) Zinsswap-Vereinbarungen

Zum 31. Dezember 2023 bestanden bei der SICAV die folgenden offenen Zinsswap-Vereinbarungen:

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund

Währung	Nennwert* (in Tsd.)	Fälligkeit	Teilfonds erhält	Fest Satz %	Variabel Zinsindex	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
CZK	3,163	18/01/29	Fest	4.43	PRIBOR 6 MONTH	5,989
BRL	3,150	04/01/27	Fest	10.45	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	5,177
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						11,166
COP	507,849	19/07/33	Variabel	8.37	COP-IBR-OIS-COMPOUND	(6,519)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(6,519)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Select Bond Fund

Währung	Nennwert* (in Tsd.)	Fälligkeit	Teilfonds erhält	Fest Satz %	Variabel Zinsindex	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
MXN	23,400	12/10/32	Fest	9.43	MXIBTIII 28 TAGE	84,641
CZK	162,178	18/01/26	Fest	4.75	PRIBOR 6 MONTH	77,292
BRL	3,977	04/01/27	Fest	13.51	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	64,420
ZAR	21,000	25/10/32	Fest	9.73	JIBAR 3 MONTH	55,481
CNY	29,190	18/01/29	Fest	2.50	CHINA FIXING REPO RATE 7 TAGE	45,708
BRL	2,671	04/01/27	Fest	13.41	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	41,897
CZK	20,873	18/01/29	Fest	4.43	PRIBOR 6 MONTH	39,523
BRL	1,998	04/01/27	Fest	13.47	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	32,011
MXN	23,700	12/10/32	Fest	8.72	MXIBTIII 28 TAGE	24,450
BRL	1,355	04/01/27	Fest	13.29	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	20,405
MXN	81,700	19/10/27	Variabel	8.78	MXIBTIII 28 TAGE	1,352
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						487,180
BRL	9,300	02/01/25	Fest	5.94	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	(223,611)
CZK	37,600	18/01/34	Variabel	4.55	PRIBOR 6 MONTH	(155,122)
BRL	7,000	04/01/27	Fest	7.27	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	(103,664)
CLP	1,105,000	18/01/34	Variabel	5.79	CLP-TNA	(88,734)
MXN	92,400	22/10/24	Fest	9.47	MXIBTIII 28 TAGE	(65,291)
BRL	2,000	04/01/27	Fest	6.13	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	(64,815)
COP	3,005,091	19/07/33	Variabel	8.37	COP-IBR-OIS-COMPOUND	(38,575)
MYR	21,680	19/04/28	Fest	3.41	KLIBOR 3 MONTH	(27,751)
COP	3,770,000	26/04/27	Fest	7.25	COP-IBR-OIS-COMPOUND	(15,837)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(783,400)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

d) Zinsswap-Vereinbarungen (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund

Währung	Nennwert* (in Tsd.)	Fälligkeit	Teilfonds erhält	Fest Satz %	Variabel Zinsindex	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
BRL	65,613	04/01/27	Fest	13.51	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	1,062,937
BRL	74,305	04/01/27	Fest	12.79	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	917,579
BRL	44,067	04/01/27	Fest	13.41	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	691,302
CZK	1,449,771	18/01/26	Fest	4.75	PRIBOR 6 MONTH	690,942
BRL	32,970	04/01/27	Fest	13.47	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	528,180
BRL	22,350	04/01/27	Fest	13.29	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	336,679
ZAR	122,800	18/01/34	Fest	9.61	JIBAR 3 MONTH	208,561
MXN	198,400	12/10/32	Fest	8.72	MXIBTIIIE 28 TAGE	204,679
BRL	82,515	04/01/27	Fest	11.07	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	188,455
MXN	350,000	12/10/32	Fest	8.47	MXIBTIIIE 28 TAGE	31,919
MXN	589,000	19/10/27	Variabel	8.78	MXIBTIIIE 28 TAGE	9,746
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						4,870,979
CZK	337,000	18/01/34	Variabel	4.55	PRIBOR 6 MONTH	(1,390,322)
CLP	9,295,000	18/01/34	Variabel	5.79	CLP-TNA	(746,411)
ZAR	591,753	31/07/25	Fest	6.30	JIBAR 3 MONTH	(740,271)
MXN	333,300	06/10/33	Fest	7.97	MXIBTIIIE 28 TAGE	(625,260)
MXN	777,600	22/10/24	Fest	9.47	MXIBTIIIE 28 TAGE	(549,465)
COP	32,475,605	19/07/33	Variabel	8.37	COP-IBR-OIS-COMPOUND	(416,878)
ZAR	448,783	15/07/25	Fest	7.18	JIBAR 3 MONTH	(95,027)
ZAR	466,044	31/07/25	Fest	7.21	JIBAR 3 MONTH	(82,880)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(4,646,514)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund

Währung	Nennwert* (in Tsd.)	Fälligkeit	Teilfonds erhält	Fest Satz %	Variabel Zinsindex	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) EUR
JPY	8,105,300	30/10/33	Variabel	1.12	JPY-TONA-OIS COMPOUND	(1,383,014)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(1,383,014)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund

Währung	Nennwert* (in Tsd.)	Fälligkeit	Teilfonds erhält	Fest Satz %	Variabel Zinsindex	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) EUR
JPY	6,353,200	30/10/33	Variabel	1.12	JPY-TONA-OIS COMPOUND	(1,084,052)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(1,084,052)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

d) Zinsswap-Vereinbarungen (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund

Währung	Nennwert* (in Tsd.)	Fälligkeit	Teilfonds erhält	Fest Satz %	Variabel Zinsindex	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) EUR
CAD	171,000	19/10/25	Fest	4.72	Canadian Overnight Repo Rate CORRA	1,510,567
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						1,510,567
CAD	38,200	19/10/33	Variabel	3.83	Canadian Overnight Repo Rate CORRA	(1,691,252)
JPY	6,300,000	30/10/33	Variabel	1.12	JPY-TONA-OIS COMPOUND	(1,074,975)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(2,766,227)

BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund

Währung	Nennwert* (in Tsd.)	Fälligkeit	Teilfonds erhält	Fest Satz %	Variabel Zinsindex	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
BRL	8,000	04/01/27	Fest	11.69	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	59,761
CZK	149,700	20/10/25	Fest	4.90	PRIBOR 6 MONTH	44,163
BRL	3,000	04/01/27	Fest	11.23	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	15,877
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						119,801
CZK	27,810	18/01/34	Variabel	4.55	PRIBOR 6 MONTH	(114,734)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(114,734)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund

Währung	Nennwert* (in Tsd.)	Fälligkeit	Teilfonds erhält	Fest Satz %	Variabel Zinsindex	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
CAD	138,500	19/10/25	Fest	4.72	Canadian Overnight Repo Rate CORRA	1,347,828
KRW	11,324,500	19/01/33	Fest	3.96	KRW CD 3M	677,001
NZD	78,300	19/10/25	Fest	5.22	NZD-BKBM FRA 3 MONTH	397,044
NOK	104,625	19/10/28	Fest	4.29	LIBOR NOK 6 MONTH	365,624
NOK	99,875	19/10/28	Fest	4.29	LIBOR NOK 6 MONTH	349,025
CNY	199,275	18/01/29	Fest	2.50	CHINA FIXING REPO RATE 7 TAGE	312,041
NZD	35,200	11/12/25	Fest	5.16	NZD-BKBM FRA 3 MONTH	195,338
NZD	38,000	19/10/25	Fest	5.22	NZD-BKBM FRA 3 MONTH	192,690
NZD	36,800	19/10/25	Fest	5.22	NZD-BKBM FRA 3 MONTH	186,605
CAD	34,800	13/12/25	Fest	4.19	Canadian Overnight Repo Rate CORRA	154,965
KRW	3,900,000	18/01/29	Fest	4.00	KRW CD 3M	141,736
KRW	2,531,600	18/01/29	Fest	3.38	KRW CD 3M	35,640
CAD	32,000	15/12/25	Fest	3.94	Canadian Overnight Repo Rate CORRA	30,019

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

d) Zinsswap-Vereinbarungen (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund (Fortsetzung)

Währung	Nennwert* (in Tsd.)	Fälligkeit	Teilfonds erhält	Fest Satz %	Variabel Zinsindex	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
ILS	6,900	19/10/28	Fest	3.64	TELBOR 3 MONTH	22,930
MYR	22,000	19/10/28	Fest	3.60	KLIBOR 3 MONTH	6,942
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						4,415,428
SEK	195,400	19/10/28	Variabel	3.57	STIBOR SEK 3 MONTH	(1,014,328)
CAD	31,500	19/10/33	Variabel	3.56	Canadian Overnight Repo Rate CORRA	(983,910)
JPY	2,038,200	30/10/33	Variabel	1.12	JPY-TONA-OIS COMPOUND	(384,175)
CAD	7,700	15/12/53	Variabel	3.11	Canadian Overnight Repo Rate CORRA	(185,237)
CAD	7,600	13/12/33	Variabel	3.37	Canadian Overnight Repo Rate CORRA	(145,634)
AUD	12,540	22/03/33	Fest	4.04	AUD BANK BILL 6 MTH	(69,352)
CAD	7,200	15/12/33	Variabel	3.21	Canadian Overnight Repo Rate CORRA	(67,697)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(2,850,333)

BlueBay Funds – BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund

Währung	Nennwert* (in Tsd.)	Fälligkeit	Teilfonds erhält	Fest Satz %	Variabel Zinsindex	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
BRL	128,000	02/01/25	Fest	11.04	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	189,747
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						189,747
JPY	38,220,000	30/10/33	Variabel	1.12	JPY-TONA-OIS COMPOUND	(7,203,987)
GBP	26,000	19/10/33	Variabel	4.43	GBP-SONIA-COMPOUND	(3,125,273)
GBP	21,500	19/10/33	Variabel	4.20	GBP-SONIA-COMPOUND	(2,060,812)
JPY	1,400,000	28/11/33	Variabel	1.01	JPY-TONA-OIS COMPOUND	(160,205)
JPY	1,600,000	05/12/33	Variabel	0.95	JPY-TONA-OIS COMPOUND	(115,799)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(12,666,076)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Government Bond Fund

Währung	Nennwert* (in Tsd.)	Fälligkeit	Teilfonds erhält	Fest Satz %	Variabel Zinsindex	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
CNY	211,400	18/01/29	Fest	2.50	CHINA FIXING REPO RATE 7 TAGE	331,027
CAD	24,600	19/10/25	Fest	4.72	Canadian Overnight Repo Rate CORRA	239,398
KRW	4,891,400	18/01/29	Fest	4.00	KRW CD 3M	177,766
KRW	2,657,500	19/01/33	Fest	3.96	KRW CD 3M	158,871
NZD	21,100	19/10/25	Fest	5.22	NZD-BKBM FRA 3 MONTH	106,994
NOK	24,353	19/10/28	Fest	4.29	LIBOR NOK 6 MONTH	85,104
NOK	23,247	19/10/28	Fest	4.29	LIBOR NOK 6 MONTH	81,240
NZD	8,900	11/12/25	Fest	5.16	NZD-BKBM FRA 3 MONTH	49,389
CZK	100,663	18/01/26	Fest	4.75	PRIBOR 6 MONTH	47,975

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

d) Zinsswap-Vereinbarungen (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Government Bond Fund (Fortsetzung)

Währung	Nennwert* (in Tsd.)	Fälligkeit	Teilfonds erhält	Fest Satz %	Variabel Zinsindex	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
CAD	8,700	13/12/25	Fest	4.19	Canadian Overnight Repo Rate CORRA	38,741
NZD	7,600	19/10/25	Fest	5.22	NZD-BKBM FRA 3 MONTH	38,538
CAD	2,200	19/10/25	Fest	5.03	Canadian Overnight Repo Rate CORRA	30,395
NZD	2,800	19/10/25	Fest	5.67	NZD-BKBM FRA 3 MONTH	27,933
CAD	2,400	19/10/25	Fest	4.77	Canadian Overnight Repo Rate CORRA	25,128
NZD	3,000	19/10/25	Fest	5.35	NZD-BKBM FRA 3 MONTH	19,489
KRW	1,268,200	18/01/29	Fest	3.38	KRW CD 3M	17,854
KRW	1,318,800	19/01/28	Fest	3.43	KRW CD 3M	15,116
CZK	55,700	18/01/26	Fest	4.49	PRIBOR 6 MONTH	14,092
CAD	11,200	15/12/25	Fest	3.94	Canadian Overnight Repo Rate CORRA	10,507
CNY	10,200	18/01/29	Fest	2.41	CHINA FIXING REPO RATE 7 TAGE	10,128
MYR	8,200	19/10/28	Fest	3.61	KLIBOR 3 MONTH	3,191
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						1,528,876
SEK	40,900	19/10/28	Variabel	3.57	STIBOR SEK 3 MONTH	(212,313)
CAD	1,700	06/11/53	Variabel	3.71	Canadian Overnight Repo Rate CORRA	(194,746)
CAD	5,600	19/10/33	Variabel	3.56	Canadian Overnight Repo Rate CORRA	(174,917)
JPY	403,300	30/10/33	Variabel	1.12	JPY-TONA-OIS COMPOUND	(76,017)
CZK	17,100	18/01/34	Variabel	4.55	PRIBOR 6 MONTH	(70,548)
CAD	2,400	15/12/53	Variabel	3.11	Canadian Overnight Repo Rate CORRA	(57,736)
CAD	1,900	13/12/33	Variabel	3.37	Canadian Overnight Repo Rate CORRA	(36,409)
CAD	500	19/10/33	Variabel	4.18	Canadian Overnight Repo Rate CORRA	(35,377)
CAD	2,500	15/12/33	Variabel	3.21	Canadian Overnight Repo Rate CORRA	(23,506)
CAD	600	19/10/33	Variabel	3.65	Canadian Overnight Repo Rate CORRA	(22,416)
AUD	3,500	22/03/33	Fest	4.04	AUD BANK BILL 6 MTH	(19,357)
CZK	6,300	18/01/34	Variabel	3.73	PRIBOR 6 MONTH	(6,220)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(929,562)

* Nennwert entspricht dem zugrunde liegenden Engagement.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

e) Credit Default Swap-Vereinbarungen (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2023 bestanden bei der SICAV die folgenden offenen Credit Default Swap-Vereinbarungen:

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund

Absicherungsposition	Wertpapierbezeichnung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
ÄGYPTEN						
Kauf	Ägyptische internationale Staatsanleihe	1.00	20/12/25	USD	2,600,000	415,413
MEXIKO						
Kauf	Petroleos Mexicanos	1.00	20/12/26	USD	1,782,000	153,432
Kauf	Petroleos Mexicanos	1.00	20/12/26	USD	398,000	34,268
Kauf	Petroleos Mexicanos	1.00	20/12/26	USD	330,000	28,413
Kauf	Petroleos Mexicanos	1.00	20/12/26	USD	245,000	21,095
						237,208
TÜRKEI						
Kauf	Türkische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/25	USD	9,910,000	27,181
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						679,802
SAUDI-ARABIEN						
Kauf	Saudi-arabische internationale Staatsanleihe	1.00	20/12/28	USD	6,200,000	(134,134)
Kauf	Saudi-arabische internationale Staatsanleihe	1.00	20/12/28	USD	6,710,000	(145,168)
						(279,302)
SÜDAFRIKA						
Kauf	Südafrikanische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	4,610,000	(14,901)
Kauf	Südafrikanische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	4,650,000	(15,031)
						(29,932)
TÜRKEI						
Kauf	Türkische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	8,207,000	(28,509)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(337,743)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund

Absicherungsposition	Wertpapierbezeichnung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) EUR
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Kauf	ITV Plc	5.00	20/12/25	EUR	12,943,000	(1,151,861)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(1,151,861)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

e) Credit Default Swap-Vereinbarungen (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund

Absicherungsposition	Wertpapierbezeichnung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
SÜDAFRIKA						
Kauf	Südafrikanische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	220,000	(711)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(711)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Select Bond Fund

Absicherungsposition	Wertpapierbezeichnung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
ÄGYPTEN						
Kauf	Ägyptische internationale Staatsanleihe	1.00	20/12/25	USD	360,000	57,519
MEXIKO						
Kauf	Petroleos Mexicanos	1.00	20/12/26	USD	276,000	23,764
Kauf	Petroleos Mexicanos	1.00	20/12/26	USD	61,000	5,252
Kauf	Petroleos Mexicanos	1.00	20/12/26	USD	38,000	3,272
						32,288
TÜRKEI						
Kauf	Türkische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/25	USD	1,530,000	4,196
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						94,003
SAUDI-ARABIEN						
Kauf	Saudi-arabische internationale Staatsanleihe	1.00	20/12/28	USD	855,000	(18,497)
Kauf	Saudi-arabische internationale Staatsanleihe	1.00	20/12/28	USD	925,000	(20,012)
						(38,509)
SÜDAFRIKA						
Kauf	Südafrikanische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	750,000	(2,424)
Kauf	Südafrikanische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	750,000	(2,424)
Kauf	Südafrikanische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	970,000	(3,136)
						(7,984)
TÜRKEI						
Kauf	Türkische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	1,124,000	(3,905)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(50,398)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

e) Credit Default Swap-Vereinbarungen (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund

Absicherungsposition	Wertpapierbezeichnung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
ISRAEL						
Kauf	Israelische internationale Staatsanleihe	1.00	20/12/28	USD	2,815,000	13,859
MEXIKO						
Kauf	Petroleos Mexicanos	1.00	20/12/26	USD	537,000	46,236
Kauf	Petroleos Mexicanos	1.00	20/12/26	USD	119,000	10,246
Kauf	Petroleos Mexicanos	1.00	20/12/26	USD	74,000	6,371
						62,853
TÜRKEI						
Kauf	Türkische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/25	USD	3,720,000	10,203
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						86,915
CHINA						
Kauf	Bank of China (Hong Kong) Ltd	1.00	20/12/25	USD	1,450,000	(17,837)
Kauf	Industrial & Commercial Bank of China Ltd/Hongkong	1.00	20/12/25	USD	1,450,000	(17,441)
						(35,278)
LUXEMBURG						
Kauf	China Construction Bank Corp Luxembourg Branch	1.00	20/12/25	USD	1,450,000	(17,962)
SAUDI-ARABIEN						
Kauf	Saudi-arabische internationale Staatsanleihe	1.00	20/12/28	USD	2,161,000	(46,752)
Kauf	Saudi-arabische internationale Staatsanleihe	1.00	20/12/28	USD	2,339,000	(50,603)
						(97,355)
SÜDAFRIKA						
Kauf	Südafrikanische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	6,070,000	(19,621)
TÜRKEI						
Kauf	Türkische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	271,000	(941)
Kauf	Türkische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	2,963,000	(10,293)
						(11,234)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(181,450)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

e) Credit Default Swap-Vereinbarungen (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund

Absicherungsposition	Wertpapierbezeichnung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
ARGENTINIEN						
Kauf	Argentinische internationale Staatsanleihe	5.00	20/12/27	USD	8,801,000	5,030,560
Kauf	Argentinische internationale Staatsanleihe	5.00	20/12/26	USD	8,794,000	4,850,803
Kauf	Argentinische internationale Staatsanleihe	5.00	20/12/26	USD	7,098,000	3,915,283
Kauf	Argentinische internationale Staatsanleihe	5.00	20/12/27	USD	4,857,000	2,776,211
Kauf	Argentinische internationale Staatsanleihe	5.00	20/12/26	USD	2,637,000	1,454,579
Kauf	Argentinische internationale Staatsanleihe	5.00	20/12/26	USD	1,002,000	552,707
						18,580,143
ÄGYPTEN						
Kauf	Ägyptische internationale Staatsanleihe	1.00	20/12/27	USD	6,255,000	1,850,481
Kauf	Ägyptische internationale Staatsanleihe	1.00	20/12/25	USD	6,255,000	999,387
Kauf	Ägyptische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/26	USD	3,505,000	733,172
Kauf	Ägyptische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/26	USD	2,522,000	527,549
Kauf	Ägyptische internationale Staatsanleihe	1.00	20/12/24	USD	6,600,000	450,475
						4,561,064
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						23,141,207
SAUDI-ARABIEN						
Kauf	Saudi-arabische internationale Staatsanleihe	1.00	20/12/28	USD	20,550,000	(444,590)
SÜDAFRIKA						
Kauf	Südafrikanische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	10,930,000	(35,330)
Kauf	Südafrikanische internationale Staatsanleihe	1.00	20/12/24	USD	10,930,000	(60,976)
						(96,306)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(540,896)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

e) Credit Default Swap-Vereinbarungen (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund

Absicherungsposition	Wertpapierbezeichnung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Verkauf	Jaguar Land Rover Automotive Plc	5.00	20/12/27	EUR	3,470,000	301,312
Verkauf	Jaguar Land Rover Automotive Plc	5.00	20/12/27	EUR	2,250,000	195,375
						496,687
VEREINIGTE STAATEN						
Verkauf	Ford Motor Co	5.00	20/12/27	USD	8,500,000	992,812
Verkauf	Ford Motor Co	5.00	20/12/27	USD	8,450,000	986,972
						1,979,784
						2,476,471
VEREINIGTE STAATEN						
Verkauf	American Airlines Group Inc	5.00	20/06/28	USD	3,749,000	(173,998)
Verkauf	American Airlines Group Inc	5.00	20/06/28	USD	4,191,000	(194,513)
						(368,511)
						(368,511)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund

Absicherungsposition	Wertpapierbezeichnung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
ISRAEL						
Kauf	Israelische internationale Staatsanleihe	1.00	20/12/28	USD	1,660,000	8,172
						8,172
CHINA						
Kauf	Bank of China (Hong Kong) Ltd	1.00	20/12/25	USD	880,000	(10,825)
Kauf	Industrial & Commercial Bank of China Ltd/Hongkong	1.00	20/12/25	USD	880,000	(10,585)
						(21,410)
LUXEMBURG						
Kauf	China Construction Bank Corp Luxembourg Branch	1.00	20/12/25	USD	880,000	(10,902)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

e) Credit Default Swap-Vereinbarungen (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund (Fortsetzung)

Absicherungsposition	Wertpapierbezeichnung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
SAUDI-ARABIEN						
Kauf	Saudi-arabische internationale Staatsanleihe	1.00	20/12/28	USD	1,282,000	(27,735)
Kauf	Saudi-arabische internationale Staatsanleihe	1.00	20/12/28	USD	1,388,000	(30,029)
						(57,764)
SÜDAFRIKA						
Kauf	Südafrikanische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	1,310,000	(4,234)
						(94,310)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund

Absicherungsposition	Wertpapierbezeichnung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) EUR
FRANKREICH						
Kauf	Valeo SA	1.00	20/12/28	EUR	4,550,000	240,903
						240,903
FRANKREICH						
Kauf	WPP Finance SA	1.00	20/12/28	EUR	9,950,000	(125,575)
DEUTSCHLAND						
Kauf	Bertelsmann SE & Co KGaA	1.00	20/12/28	EUR	9,970,000	(268,859)
NIEDERLANDE						
Kauf	Stellantis NV	5.00	20/12/28	EUR	4,990,000	(874,238)
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Kauf	British Telecommunications Plc	1.00	20/12/28	EUR	10,070,000	(114,281)
Kauf	Marks & Spencer Plc	1.00	20/12/28	EUR	4,320,000	(4,691)
						(118,972)
VEREINIGTE STAATEN						
Kauf	Avnet Inc	1.00	20/06/28	USD	7,276,000	(35,384)
Kauf	Eastman Chemical Co	1.00	20/06/28	USD	17,710,000	(231,869)
						(267,253)
						(1,654,897)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

e) Credit Default Swap-Vereinbarungen (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund

Absicherungsposition	Wertpapierbezeichnung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
ISRAEL						
Kauf	Israelische internationale Staatsanleihe	1.00	20/12/28	USD	553,000	2,722
Kauf	Israelische internationale Staatsanleihe	1.00	20/12/28	USD	317,000	1,561
						4,283
MEXIKO						
Kauf	Petroleos Mexicanos	1.00	20/12/26	USD	478,000	41,156
Kauf	Petroleos Mexicanos	1.00	20/12/26	USD	106,000	9,127
Kauf	Petroleos Mexicanos	1.00	20/12/26	USD	66,000	5,683
						55,966
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						60,249
CHINA						
Kauf	Bank of China (Hong Kong) Ltd	1.00	20/12/25	USD	850,000	(10,456)
Kauf	Industrial & Commercial Bank of China Ltd/Hongkong	1.00	20/12/25	USD	850,000	(10,224)
						(20,680)
LUXEMBURG						
Kauf	China Construction Bank Corp Luxembourg Branch	1.00	20/12/25	USD	850,000	(10,530)
SÜDAFRIKA						
Kauf	Südafrikanische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	840,000	(2,715)
TÜRKEI						
Kauf	Türkische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	1,218,000	(4,231)
						(38,156)

BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund

Absicherungsposition	Wertpapierbezeichnung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
VEREINIGTE STAATEN						
Verkauf	Ford Motor Co	5.00	20/12/28	USD	7,870,000	1,011,992
						1,011,992
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						1,011,992

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

e) Credit Default Swap-Vereinbarungen (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund (Fortsetzung)

Absicherungsposition	Wertpapierbezeichnung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
VEREINIGTE STAATEN						
Kauf	Avnet Inc	1.00	20/06/28	USD	6,438,000	(34,585)
Kauf	Eastman Chemical Co	1.00	20/06/28	USD	7,895,000	(114,183)
						(148,768)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(148,768)

BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund

Absicherungsposition	Wertpapierbezeichnung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
SÜDAFRIKA						
Kauf	Südafrikanische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	1,320,000	(4,267)
						(4,267)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(4,267)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund

Absicherungsposition	Wertpapierbezeichnung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
ÄGYPTEN						
Kauf	Ägyptische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/26	USD	3,429,000	717,275
Kauf	Ägyptische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/26	USD	1,770,000	370,247
						1,087,522
ISRAEL						
Kauf	Israelische internationale Staatsanleihe	1.00	20/12/28	USD	3,293,000	16,212
Kauf	Israelische internationale Staatsanleihe	1.00	20/12/28	USD	1,882,000	9,265
						25,477
MEXIKO						
Kauf	Petroleos Mexicanos	1.00	20/12/25	USD	2,590,000	114,211
SÜDAFRIKA						
Kauf	Südafrikanische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/28	USD	3,750,000	130,794
Kauf	Südafrikanische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/28	USD	470,000	16,393
						147,187

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

e) Credit Default Swap-Vereinbarungen (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund (Fortsetzung)

Absicherungsposition	Wertpapierbezeichnung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
TÜRKEI						
Kauf	Türkische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/25	USD	3,830,000	10,505
Kauf	Türkische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/25	USD	890,000	2,441
Kauf	Türkische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/25	USD	480,000	1,317
						14,263
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						1,388,660
SÜDAFRIKA						
Kauf	Südafrikanische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	700,000	(2,263)
Kauf	Südafrikanische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	1,510,000	(4,881)
Kauf	Südafrikanische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	1,870,000	(6,044)
Kauf	Südafrikanische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	3,730,000	(12,057)
						(25,245)
TÜRKEI						
Kauf	Türkische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	1,620,000	(5,628)
Kauf	Türkische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	2,600,000	(9,032)
Kauf	Türkische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	12,952,000	(44,993)
						(59,653)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(84,898)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund

Absicherungsposition	Wertpapierbezeichnung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
MEXIKO						
Kauf	Petroleos Mexicanos	1.00	20/12/25	USD	340,000	14,993
SÜDAFRIKA						
Kauf	Südafrikanische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/28	USD	440,000	15,346
Kauf	Südafrikanische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/28	USD	110,000	3,837
						19,183
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						34,176

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

e) Credit Default Swap-Vereinbarungen (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund (Fortsetzung)

Absicherungsposition	Wertpapierbezeichnung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) USD
SÜDAFRIKA						
Kauf	Südafrikanische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	200,000	(647)
Kauf	Südafrikanische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	215,000	(695)
Kauf	Südafrikanische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	220,000	(711)
Kauf	Südafrikanische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	440,000	(1,422)
						(3,475)
TÜRKEI						
Kauf	Türkische internationale Staatsanleihe	1.00	20/06/24	USD	670,000	(2,327)
						(5,802)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(5,802)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade ESG Bond Fund

Absicherungsposition	Wertpapierbezeichnung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/ (-rückgänge) EUR
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
Kauf	ITV Plc	5.00	20/12/25	EUR	210,000	(18,689)
						(18,689)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(18,689)

* Nennwert entspricht dem zugrunde liegenden Engagement.

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

f) Credit Default Index Swap-Vereinbarungen

Zum 31. Dezember 2023 bestanden bei der SICAV die folgenden offenen Credit Default Index Swap-Vereinbarungen:

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund

Absicherungsposition	Indexbeschreibung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
VEREINIGTE STAATEN						
Kauf	iTraxx Europe Index	1.00	20/06/28	EUR	19,150,000	(428,888)
Kauf	iTraxx Europe Index	1.00	20/06/28	EUR	19,450,000	(435,606)
Kauf	iTraxx Europe Senior Financial Index	1.00	20/12/27	EUR	19,620,000	(377,464)
						(1,241,958)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(1,241,958)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund

Absicherungsposition	Indexbeschreibung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) EUR
VEREINIGTE STAATEN						
Kauf	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/12/28	USD	76,616,000	(1,345,110)
Kauf	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/12/28	USD	89,714,000	(1,575,066)
Kauf	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/12/28	USD	237,569,000	(4,170,885)
Kauf	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/12/28	USD	271,577,000	(4,767,947)
Kauf	iTraxx Europe Crossover Index	5.00	20/12/28	EUR	21,029,000	(1,674,861)
Kauf	iTraxx Europe Crossover Index	5.00	20/12/28	EUR	24,150,000	(1,923,434)
						(15,457,303)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(15,457,303)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Select Bond Fund

Absicherungsposition	Indexbeschreibung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
VEREINIGTE STAATEN						
Kauf	iTraxx Europe Senior Financial Index	1.00	20/12/27	EUR	3,200,000	(61,564)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(61,564)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

f) Credit Default Index Swap-Vereinbarungen (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund

Absicherungsposition	Indexbeschreibung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
VEREINIGTE STAATEN						
Kauf	CDX Emerging Markets Index	1.00	20/12/28	USD	3,690,000	106,755
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						106,755
VEREINIGTE STAATEN						
Kauf	iTraxx Europe Index	1.00	20/06/28	EUR	7,610,000	(170,435)
Kauf	iTraxx Europe Senior Financial Index	1.00	20/12/27	EUR	9,110,000	(175,265)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(345,700)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund

Absicherungsposition	Indexbeschreibung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
VEREINIGTE STAATEN						
Kauf	CDX Emerging Markets Index	1.00	20/12/28	USD	65,923,000	1,907,222
Kauf	CDX Emerging Markets Index	1.00	20/12/28	USD	39,647,000	1,147,029
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						3,054,251

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund

Absicherungsposition	Indexbeschreibung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) EUR
VEREINIGTE STAATEN						
Kauf	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/12/28	USD	11,375,000	(199,705)
Kauf	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/12/28	USD	13,320,000	(233,853)
Kauf	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/12/28	USD	35,273,000	(619,271)
Kauf	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/12/28	USD	40,322,000	(707,914)
Kauf	iTraxx Europe Crossover Index	5.00	20/12/28	EUR	26,960,000	(2,147,237)
Kauf	iTraxx Europe Crossover Index	5.00	20/12/28	EUR	29,033,000	(2,312,342)
Kauf	iTraxx Europe Index	1.00	20/12/28	EUR	252,000,000	(4,893,424)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(11,113,746)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

f) Credit Default Index Swap-Vereinbarungen (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund

Absicherungsposition	Indexbeschreibung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
VEREINIGTE STAATEN						
Kauf	iTraxx Europe Senior Financial Index	1.00	20/12/27	EUR	5,060,000	(97,348)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(97,348)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund

Absicherungsposition	Indexbeschreibung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) EUR
VEREINIGTE STAATEN						
Kauf	CDX North America High Yield Index	5.00	20/12/28	USD	11,979,000	(626,134)
Kauf	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/12/28	USD	64,993,000	(1,141,051)
Kauf	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/12/28	USD	76,103,000	(1,336,104)
Kauf	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/12/28	USD	201,526,000	(3,538,095)
Kauf	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/12/28	USD	230,375,000	(4,044,583)
Kauf	iTraxx Europe Crossover Index	5.00	20/12/28	EUR	10,370,000	(825,922)
Kauf	iTraxx Europe Crossover Index	5.00	20/12/28	EUR	19,797,000	(1,576,738)
Kauf	iTraxx Europe Index	1.00	20/12/28	EUR	97,000,000	(1,883,580)
						(14,972,207)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(14,972,207)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund

Absicherungsposition	Indexbeschreibung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
VEREINIGTE STAATEN						
Kauf	iTraxx Europe Senior Financial Index	1.00	20/12/27	EUR	3,758,000	(72,299)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(72,299)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

f) Credit Default Index Swap-Vereinbarungen (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund

Absicherungsposition	Indexbeschreibung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
VEREINIGTE STAATEN						
Kauf	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/12/28	USD	135,507,000	(2,627,997)
Kauf	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/12/28	USD	230,000,000	(4,460,577)
Kauf	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/12/28	USD	233,659,000	(4,531,538)
						(11,620,112)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(11,620,112)

BlueBay Funds – BlueBay Financial Capital Bond Fund

Absicherungsposition	Indexbeschreibung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
VEREINIGTE STAATEN						
Kauf	CDX North America High Yield Index	5.00	20/12/28	USD	43,876,800	(2,533,414)
Kauf	iTraxx Europe Crossover Index	5.00	20/12/28	EUR	50,791,000	(4,468,601)
						(7,002,015)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(7,002,015)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund

Absicherungsposition	Indexbeschreibung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
VEREINIGTE STAATEN						
Kauf	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/12/28	USD	13,729,000	(266,257)
Kauf	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/12/28	USD	16,077,000	(311,794)
Kauf	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/12/28	USD	42,571,000	(825,614)
Kauf	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/12/28	USD	48,666,000	(943,819)
Kauf	iTraxx Europe Crossover Index	5.00	20/12/28	EUR	3,800,000	(334,325)
Kauf	iTraxx Europe Crossover Index	5.00	20/12/28	EUR	9,330,000	(820,855)
Kauf	iTraxx Europe Crossover Index	5.00	20/12/28	EUR	19,124,000	(1,682,533)
Kauf	iTraxx Europe Index	1.00	20/12/28	EUR	108,200,000	(2,320,942)
						(7,506,139)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(7,506,139)

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

f) Credit Default Index Swap-Vereinbarungen (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund

Absicherungsposition	Indexbeschreibung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
VEREINIGTE STAATEN						
Kauf	CDX Emerging Markets Index	1.00	20/12/28	USD	17,200,000	497,614
Kauf	CDX Emerging Markets Index	1.00	20/12/28	USD	5,140,000	148,706
Kauf	CDX Emerging Markets Index	1.00	20/12/28	USD	5,020,000	145,234
						791,554
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						791,554
VEREINIGTE STAATEN						
Kauf	iTraxx Europe Index	1.00	20/06/28	EUR	1,000,000	(22,396)
Kauf	iTraxx Europe Index	1.00	20/06/28	EUR	1,810,000	(40,537)
Kauf	iTraxx Europe Index	1.00	20/06/28	EUR	7,950,000	(178,050)
Kauf	iTraxx Europe Senior Financial Index	1.00	20/12/27	EUR	2,100,000	(40,402)
Kauf	iTraxx Europe Senior Financial Index	1.00	20/12/27	EUR	16,730,000	(321,865)
						(603,250)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(603,250)

BlueBay Funds – BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund

Absicherungsposition	Indexbeschreibung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
VEREINIGTE STAATEN						
Kauf	CDX Emerging Markets Index	1.00	20/12/28	USD	35,400,000	1,024,159
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						1,024,159
VEREINIGTE STAATEN						
Kauf	iTraxx Europe Crossover Index	5.00	20/12/28	EUR	52,288,000	(4,600,307)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(4,600,307)

BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund

Absicherungsposition	Indexbeschreibung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
VEREINIGTE STAATEN						
Verkauf	CDX North America High Yield Index	5.00	20/12/28	USD	23,721,000	1,369,633
Verkauf	CDX North America High Yield Index	5.00	20/12/28	USD	4,904,000	283,153
						1,652,786
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						1,652,786

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

9 Anlagen in derivativen Transaktionen (Fortsetzung)

f) Credit Default Index Swap-Vereinbarungen (Fortsetzung)

BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund

Absicherungsposition	Indexbeschreibung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) USD
VEREINIGTE STAATEN						
Kauf	CDX Emerging Markets Index	1.00	20/12/28	USD	1,260,000	36,453
Nicht realisierter Wertanstieg insgesamt						36,453
VEREINIGTE STAATEN						
Kauf	iTraxx Europe Senior Financial Index	1.00	20/12/27	EUR	183,000	(3,521)
Kauf	iTraxx Europe Senior Financial Index	1.00	20/12/27	EUR	730,000	(14,044)
						(17,565)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(17,565)

BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade ESG Bond Fund

Absicherungsposition	Indexbeschreibung	Satz %	Fälligkeit	Währung	Nennwert*	Nicht realisierte Wertanstiege/(-rückgänge) EUR
VEREINIGTE STAATEN						
Kauf	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/12/28	USD	776,000	(13,624)
Kauf	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/12/28	USD	909,000	(15,959)
Kauf	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/12/28	USD	2,406,000	(42,241)
Kauf	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/12/28	USD	2,751,000	(48,298)
Kauf	iTraxx Europe Crossover Index	5.00	20/12/28	EUR	206,000	(16,407)
Kauf	iTraxx Europe Crossover Index	5.00	20/12/28	EUR	240,000	(19,115)
						(155,644)
Nicht realisierter Wertrückgang insgesamt						(155,644)

* Nennwert entspricht dem zugrunde liegenden Engagement.

Erläuterungen zum Abschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

10 Aufstellung der Veränderungen des Wertpapierbestands

Eine Aufstellung der Veränderungen des Wertpapierbestands für den Berichtszeitraum bis zum 31. Dezember 2023 ist kostenlos am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft, wie auf Seite 4 beschrieben, erhältlich.

11 Bedeutsame Ereignisse während des Berichtszeitraums

Fonds, die Additional-Tier-1-Schuldtitel (AT1) von Credit Suisse hielten, haben formell eine Klage gegen die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht (FINMA) eingereicht und stellen daher weiterhin eine Position dar, die zum Forderungswert auf der Grundlage mehrerer handelbarer Händlernerotierungen bewertet ist.

Die Adresse des Anlageverwalters wurde am 3. Juli 2023 in 100 Bishopsgate, London, EC2N 4AA, Vereinigtes Königreich geändert.

Der neue Verkaufsprospekt für BlueBay Funds wurde am 4. August 2023 mit einem Sichtvermerk versehen.

Terrence Alfred Farrelly trat am 8. August 2023 von seiner Position als Verwaltungsratsmitglied der Verwaltungsgesellschaft zurück.

Heidi Gunkel wurde am 8. August 2023 in den Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft berufen.

Adil Chaudhry wurde am 8. August 2023 in den Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft berufen.

Henry Kelly trat am 27. Oktober 2023 als Verwaltungsratsmitglied der SICAV zurück.

Tracey McDermott wurde am 27. Oktober 2023 in den Verwaltungsrat der SICAV berufen.

Lucian Orlovius trat am 11. Dezember 2023 von seiner Position als Conducting Officer der Verwaltungsgesellschaft zurück.

Anne-Sophie Girault wurde am 11. Dezember 2023 zum Conducting Officer der Gesellschaft ernannt.

Lucian Orlovius trat am 11. Dezember 2023 von seiner Position als Verwaltungsratsmitglied der Verwaltungsgesellschaft zurück.

Hervé Leite-Faria wurde am 11. Dezember 2023 in den Verwaltungsrat der Gesellschaft berufen.

Abgesehen davon gab es während des Berichtszeitraums keine weiteren bedeutsamen Ereignisse, die einen wesentlichen Einfluss auf den Abschluss gehabt hätten.

12 Bedeutsame Ereignisse nach dem Ende des Berichtszeitraums

Der Teilfonds BlueBay Funds – BlueBay Global Convertible Bond Fund wurde am 19. Januar 2024 liquidiert.

Der neue Verkaufsprospekt für BlueBay Funds wurde am 26. Januar 2024 mit dem Sichtvermerk versehen.

Der Teilfonds BlueBay High Grade Structured Credit Short Duration Fund wurde am 1. Februar 2024 in BlueBay High Grade Short Duration Asset-Backed Credit Fund umbenannt.

Der Teilfonds BlueBay Investment Grade Structured Credit Fund wurde am 1. Februar 2024 in BlueBay Investment Grade Asset-Backed Credit Fund umbenannt.

Abgesehen davon gab es seit Ende des Berichtszeitraums keine weiteren bedeutsamen Ereignisse, die einen wesentlichen Einfluss auf den Abschluss haben könnten.

Anhänge

Anhang 1 Aktivitäten in den Aktienklassen

Anhang 2: Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Anhang 3: EU-Offenlegungsverordnung

BlueBay Funds

Société d'Investissement à Capital Variable

Anhang 1 – Aktivitäten in den Aktienklassen

Aktivitäten in den Aktienklassen im Berichtszeitraum:

Fondsname	Aktienklasse	Auflegungsdatum	Schließungsdatum	Neuauflegungsdatum
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Bond Fund	Q - EUR	20. Dezember 2023	-	-
BlueBay Funds – BlueBay High Yield ESG Bond Fund	M - USD M - USD (MIDiv) S - EUR (AIDiv) S - USD (AIDiv) V - EUR V - GBP (QIDiv) V - USD V - USD (QIDiv)	26. September 2023 13. November 2023 - - 26. September 2023 26. September 2023 26. September 2023 26. September 2023	- - - - - - - -	- - 13. November 2023 13. November 2023 - - - -
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Bond Fund	M - GBP	-	30. August 2023	-
BlueBay Funds – BlueBay Global Convertible Bond Fund	B - GBP (BHedged) I - USD (Perf)	- -	16. August 2023 5. Juli 2023	- -
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund	Q - GBP Q - GBP (QIDiv) Q - USD R - CHF R - EUR R - USD	18. Oktober 2023 04. Dezember 2023 - 05. Oktober 2023 05. Oktober 2023 16. August 2023	- - 18. Oktober 2023 - - -	- - - - - -
BlueBay Funds – BlueBay Global High Yield Bond Fund	Q - SEK	-	16. November 2023	-
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund	M - CHF Q - USD	- -	12. Juli 2023 21. Dezember 2023	- -
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund	I - USD I - USD (Perf)	- -	- 22. Dezember 2023	15. September 2023 -
BlueBay Funds – BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund	C - GBP I - GBP R - USD (QIDiv) Y - GBP Y - GBP (MIDiv)	- - - 16. August 2023 16. August 2023	- - - - -	18. Juli 2023 07. September 2023 03. August 2023 - -
BlueBay Funds – BlueBay Total Return Credit Fund	C - EUR (QIDiv) M - EUR	- -	5. Dezember 2023 9. Oktober 2023	- -
BlueBay Funds – BlueBay Financial Capital Bond Fund	K - CHF	-	28. Juli 2023	-
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund	Q - EUR	20. Dezember 2023	-	-
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund	K - GBP K - GBP (MIDiv)	12. Juli 2023 12. Juli 2023	- -	- -

BlueBay Funds
Société d'Investissement à Capital Variable

Anhang 1 – Aktivitäten in den Aktienklassen (Fortsetzung)

Fondsname	Aktienklasse	Auflegungsdatum	Schließungsdatum	Neuauflegungsdatum
BlueBay Funds – BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund	I - JPY (Perf)	-	-	19. September 2023
	S - USD (CPerf)	-	30. November 2023	-
BlueBay Funds – BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund	R - EUR	26. Oktober 2023	14. Dezember 2023	-
BlueBay Funds – BlueBay High Grade Structured Credit Short Duration Fund	G - EUR	29. November 2023	-	-
	K - USD	09. August 2023	-	-
BlueBay Funds – BlueBay Impact-Aligned Bond Fund	K - GBP	03. August 2023	-	-
	S - GBP	04. Dezember 2023	-	-
	S - GBP (QIDiv)	04. Dezember 2023	-	-
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Global Government Bond Fund	Q - GBP	18. Oktober 2023	-	-
	Q - GBP (QIDiv)	04. Dezember 2023	-	-
	S - CHF	22. Dezember 2023	-	-
	S - EUR	23. November 2023	-	-
	S - GBP	23. November 2023	-	-
	S - USD	23. November 2023	-	-
BlueBay Funds – BlueBay Investment Grade Financials Plus Bond Fund	C - GBP	18. Oktober 2023	-	-
	C - GBP (QCDiv)	18. Oktober 2023	-	-
	S - GBP	04. Dezember 2023	-	-
	S - GBP (QIDiv)	04. Dezember 2023	-	-

Anhang 2 – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Die EU-Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften („SFT-Verordnung“) führt Meldepflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („Securities Financing Transactions“ oder „SFTs“) und Total Return Swaps ein.

Ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft (SFT) ist gemäß Artikel 3(11) der SFT-Verordnung definiert als:

- ein Pensionsgeschäft/umgekehrtes Pensionsgeschäft,
- ein Wertpapier- oder Warenleihgeschäft,
- ein Kauf-/Rückverkaufgeschäft oder ein Verkauf-/Rückkaufgeschäft, oder
- ein Lombardgeschäft.

Zum 31. Dezember 2023 hielten die Teilfonds keine Instrumente, die in den Anwendungsbereich der SFT-Verordnung fallen.

Anhang 3 – EU-Offenlegungsverordnung

Die folgende Tabelle zeigt die Klassifizierungen der Teilfonds gemäß der Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“) zum 31. Dezember 2023:

Teilfonds	SFDR-Kategorie
BlueBay Emerging Market Bond Fund	Artikel 8
BlueBay High Yield ESG Bond Fund	Artikel 8
BlueBay Investment Grade Bond Fund	Artikel 8
BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund	Artikel 6
BlueBay Emerging Market Select Bond Fund	Artikel 8
BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund	Artikel 8
BlueBay Global Convertible Bond Fund	Artikel 8
BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund	Artikel 8
BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund	Artikel 8
BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund	Artikel 8
BlueBay Global High Yield Bond Fund	Artikel 6
BlueBay Emerging Market Investment Grade Corporate Bond Fund	Artikel 8
BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund	Artikel 8
BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund	Artikel 8
BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund	Artikel 8
BlueBay Total Return Credit Fund	Artikel 8
BlueBay Financial Capital Bond Fund	Artikel 8
BlueBay Investment Grade Global Aggregate Bond Fund	Artikel 8
BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund	Artikel 8
BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund	Artikel 8
BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund	Artikel 8
BlueBay Investment Grade Structured Credit Fund	Artikel 6
BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund	Artikel 8
BlueBay High Grade Structured Credit Short Duration Fund	Artikel 6
BlueBay Investment Grade ESG Bond Fund	Artikel 8
BlueBay Impact-Aligned Bond Fund	Artikel 9
BlueBay Investment Grade Global Government Bond Fund	Artikel 8
BlueBay Investment Grade Financials Plus Bond Fund	Artikel 8